

Fecha de Publicación: 26 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 24 de Agosto de 2009¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$753,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	272,9	130,0	38,2	150,7	26,7	57,2	337,8
15-35	182,9	225,8	190,8	51,0	3,0	99,8	376,7
36-60	14,2	1,2	0,0	0,0	1,2	14,2	15,4
61-90	0,1	0,5	0,0	0,0	0,5	0,1	0,6
91-180	0,5	13,2	0,0	0,0	13,2	0,5	13,7
>180	5,9	3,7	0,0	0,0	3,7	5,9	9,6
Total	476,4	374,4	229,0	201,7	48,3	177,7	753,8

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,5 %	4,8 %	4,4 %	4,0 %
15-35	4,4 %	5,1 %	4,7 %	4,9 %
36-60	-	5,3 %	4,6 %	4,6 %
61-90	-	9,3 %	4,0 %	8,8 %
91-180	-	5,1 %	4,4 %	5,0 %
>180	-	5,1 %	4,7 %	4,8 %
Total	3,1 %	5,0 %	4,6 %	4,5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	24 al 28 de Agosto				31 de Ago. al 4 de Septiembre				7 al 11 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	25	2270	1969	5	22	1299	1475	4	21	880	929
Intragrupa y off-shore***	0	1	861	739	0	0	825	337	0	0	651	208
Otros	25	10	675	1097	22	5	398	709	21	4	131	525
Total	36	36	3805	3805	26	26	2522	2522	26	26	1662	1662

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo