

Fecha de Publicación: 27 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 25 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\$733,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	196,3	149,2	6,1	47,7	123,1	128,6	325,5
15-35	189,0	155,8	103,7	83,0	19,1	73,0	311,8
36-60	28,2	35,6	35,0	0,0	0,6	28,2	63,8
61-90	3,0	1,1	0,0	0,0	1,1	3,0	4,1
91-180	6,9	16,1	10,0	0,0	6,1	6,9	23,0
>180	3,1	1,9	0,0	0,0	1,9	3,1	5,0
Total	426,4	359,7	154,8	130,7	151,9	242,7	733,1

* 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	4,7 %	4,9 %	4,0 %	4,4 %
15-35	4,8 %	5,3 %	4,8 %	5,0 %
36-60	-	5,0 %	4,6 %	4,7 %
61-90	-	5,3 %	4,6 %	4,8 %
91-180	-	5,2 %	4,2 %	4,9 %
>180	-	5,2 %	4,6 %	4,8 %
Total	4,7 %	5,1 %	4,4 %	4,7 %

*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**	9	25	2359	2036	5	22	1395	1558	5	21	890	930
Intragrupa y off-shore***	0	1	861	750	0	0	831	372	0	0	651	210
Otros	25	8	742	1176	22	5	454	750	21	5	132	533
Total	34	34	3962	3962	26	26	2680	2680	26	26	1673	1673

* 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