

Fecha de Publicación: 28 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 26 de Agosto de 2009 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$890,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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	250,8	159,9	53,9	143,5	106,0	107,3	410,7
15-35	216,4	223,6	108,7	82,0	62,9	82,4	388,0
36-60	11,5	12,2	10,0	0,0	2,2	11,5	23,7
61-90	1,5	3,8	0,0	0,0	3,8	1,5	5,3
91-180	6,0	51,2	25,0	0,0	26,2	6,0	57,2
>180	4,3	1,3	0,0	0,0	1,3	4,3	5,6
Total	490,6	451,9	197,6	225,5	202,3	213,1	890,5

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

*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

Sector	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	24	2382	2038	5	22	1607	1707	6	22	925	945
Intragrupa y off-shore***	0	1	861	772	0	0	885	483	0	0	656	223
Otros	24	8	744	1176	22	5	550	852	22	6	142	555
Total	33	33	3986	3986	27	27	3042	3042	28	28	1723	1723

* 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