

Fecha de Publicación: 31 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 27 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\$917,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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 | 113,5 | 150,6 | 80,0 | 6,1 | 65,6 | 102,4 | 259,0 |
| 15-35 | 281,3 | 354,0 | 257,8 | 69,0 | 31,1 | 147,2 | 570,2 |
| 36-60 | 19,9 | 4,8 | 0,0 | 0,0 | 4,8 | 19,9 | 24,7 |
| 61-90 | 11,4 | 0,5 | 0,0 | 0,0 | 0,5 | 11,4 | 11,9 |
| 91-180 | 12,0 | 28,8 | 6,1 | 0,0 | 12,7 | 2,0 | 30,8 |
| >180 | 3,7 | 17,1 | 15,0 | 0,0 | 2,1 | 3,7 | 20,8 |
| Total | 441,8 | 555,7 | 358,9 | 75,0 | 116,7 | 286,7 | 917,4 |

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

*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 | 25 | 2382 | 2038 | 5 | 21 | 1686 | 1836 | 6 | 22 | 960 | 988 | | |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 1 | 861 | 772 | 0 | 0 | 957 | 489 | 0 | 0 | 684 | 223 | | |
| Otros | 25 | 8 | 744 | 1176 | 21 | 5 | 602 | 920 | 22 | 6 | 157 | 590 | | |
| Total | 34 | 34 | 3986 | 3986 | 26 | 26 | 3245 | 3245 | 28 | 28 | 1801 | 1801 | | |

* 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