

Fecha de Publicación: 1 de Septiembre de 2009
 Fecha de Información: 28 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\$551,3 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	103,5	86,8	29,0	7,5	57,8	96,0	190,3
15-35	196,4	126,3	102,0	102,7	17,8	87,2	316,2
36-60	10,6	0,1	0,0	0,0	0,1	10,6	10,7
61-90	12,5	0,7	0,0	0,0	0,7	12,5	13,2
91-180	1,1	16,7	0,0	0,0	16,7	1,1	17,8
>180	0,2	2,9	0,0	0,0	2,9	0,2	3,1
Total	324,2	233,6	131,0	110,2	96,1	207,5	551,3

* 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	-	5,0 %	4,5 %	4,7 %
15-35	4,8 %	5,1 %	4,6 %	4,8 %
36-60	-	5,1 %	4,5 %	4,5 %
61-90	-	5,4 %	4,6 %	4,7 %
91-180	-	5,1 %	4,3 %	5,0 %
>180	-	6,0 %	4,7 %	5,9 %
Total	4,8 %	5,1 %	4,5 %	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	27	2380	2040	5	19	1745	1907	6	23	1005	1002
Intragrupa y off-shore***	0	1	861	772	0	0	977	497	0	0	693	223
Otros	27	8	746	1175	19	5	653	971	23	6	162	635
Total	36	36	3987	3987	24	24	3375	3375	29	29	1859	1859

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo