

Fecha de Publicación: 3 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 01 de Septiembre 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\$740,7 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 | 161,6 | 142,6 | 4,0 | 51,5 | 138,6 | 110,1 | 304,2 |
| 15-35 | 70,6 | 271,7 | 207,0 | 11,0 | 49,8 | 44,6 | 327,4 |
| 36-60 | 8,0 | 3,2 | 0,0 | 0,0 | 3,2 | 8,0 | 11,2 |
| 61-90 | 67,0 | 3,8 | 0,0 | 0,0 | 3,8 | 67,0 | 70,9 |
| 91-180 | 11,2 | 12,6 | 0,0 | 0,0 | 12,6 | 11,2 | 23,8 |
| >180 | 0,0 | 3,2 | 0,0 | 0,0 | 3,2 | 0,0 | 3,2 |
| Total | 318,5 | 437,2 | 211,0 | 62,5 | 211,2 | 241,0 | 740,7 |

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

| Sector | 31 de Ago. al 4 de Septiembre | | | | | | | | | | | | 7 al 11 de Septiembre | | | | | | 14 al 18 de Septiembre | | | | | |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------------------|---|-----|---|----------|---|------------------------|--|--|--|--|--|
| | Delivery | | | | NDF | | | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | | | | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | | | | | | |
| Sector Financiero** | 6 | 19 | 1898 | 2052 | 9 | 24 | 1169 | 1122 | 13 | 32 | 1289 | 1413 | | | | | | | | | | | | |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1012 | 553 | 0 | 0 | 715 | 318 | 0 | 0 | 998 | 548 | | | | | | | | | | | | |
| Otros | 19 | 6 | 753 | 1058 | 24 | 9 | 260 | 704 | 32 | 13 | 218 | 544 | | | | | | | | | | | | |
| Total | 25 | 25 | 3663 | 3663 | 32 | 32 | 2144 | 2144 | 45 | 45 | 2505 | 2505 | | | | | | | | | | | | |

* 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