

Fecha de Publicación: 4 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 02 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\$1326,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	460,5	180,5	98,4	396,4	61,7	43,8	620,7
15-35	307,8	340,7	244,3	152,4	36,9	96,0	589,1
36-60	8,7	34,2	11,0	1,3	23,2	7,4	42,9
61-90	0,8	5,9	0,0	0,0	5,9	0,8	6,8
91-180	10,1	42,7	25,0	0,0	7,7	0,1	42,8
>180	0,0	24,1	0,0	0,0	24,1	0,0	24,1
Total	787,9	628,2	378,7	550,0	159,7	148,1	1326,3

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

*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									
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V										
Sector Financiero**	7	19	1998	2059	9	24	1320	1260	13	32	1537	1474												
Intragrupa y off-shore***	0	0	1017	635	0	0	806	427	0	0	1020	774												
Otros	19	7	754	1076	24	9	305	746	32	13	237	546												
Total	26	26	3769	3769	33	33	2432	2432	45	45	2794	2794												

* 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