

Fecha de Publicación: 7 de Septiembre de 2009
 Fecha de Información: 03 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\$1401,1 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	218,8	417,5	273,7	82,0	108,8	101,8	601,3
15-35	253,3	457,9	367,0	62,7	12,9	112,6	633,2
36-60	11,5	48,8	40,0	0,0	8,8	11,5	60,3
61-90	72,0	8,5	0,0	0,0	3,5	67,0	75,5
91-180	1,0	15,6	0,0	0,0	15,6	1,0	16,6
>180	9,5	4,7	0,0	0,0	4,7	9,5	14,3
Total	566,2	953,0	680,7	144,7	154,3	303,5	1401,1

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

Sectores	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
Sector Financiero**	6	21	1999	2059	9	24	1483	1409	13	32	1593	1745
Intragrupa y off-shore***	0	0	1017	635	0	0	836	505	0	0	1264	778
Otros	21	6	755	1077	24	9	410	816	32	13	244	578
Total	27	27	3770	3770	34	34	2730	2730	44	44	3101	3101

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo