

Fecha de Publicación: 10 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 08 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\$820,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	192,7	56,6	5,4	71,0	40,9	111,4	238,9
15-35	350,6	327,1	142,2	45,5	37,8	158,0	530,5
36-60	9,7	7,1	0,0	0,0	7,1	9,7	16,8
61-90	0,0	5,4	0,0	0,0	5,4	0,0	5,5
91-180	0,3	17,1	0,0	0,0	17,0	0,2	17,3
>180	0,0	11,4	0,0	0,0	11,4	0,0	11,4
Total	553,3	424,6	147,6	116,5	119,6	279,3	820,5

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

*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	7 al 11 de Septiembre						14 al 18 de Septiembre						21 al 25 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		
Sector Financiero**	11	25	1650	1502	17	38	1829	1806	8	30	1144	1354						
Intragrupa y off-shore***	0	0	836	580	5	0	1264	835	0	0	822	347						
Otros	25	11	483	888	33	17	260	712	30	8	266	532						
Total	35	35	2970	2970	55	55	3353	3353	38	38	2232	2232						

* 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