

Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 09 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\$938,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.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	313,2	274,3	85,2	198,3	179,0	104,9	577,5
15-35	123,8	148,5	112,0	47,3	21,5	61,5	257,3
36-60	23,2	12,6	4,0	0,0	8,6	23,2	35,9
61-90	27,9	5,0	0,0	1,8	5,0	26,0	32,9
91-180	10,0	9,8	0,5	0,0	9,3	10,0	19,8
>180	10,6	9,7	0,0	5,6	4,7	0,0	15,3
Total	508,7	460,0	201,7	252,9	228,3	225,7	938,7

* 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	0,0 %	5,2 %	4,2 %	4,6 %
15-35	5,6 %	5,5 %	4,8 %	5,2 %
36-60	-	5,5 %	4,8 %	5,0 %
61-90	-	5,4 %	5,0 %	5,1 %
91-180	-	5,6 %	4,8 %	5,2 %
>180	5,0 %	5,5 %	5,3 %	5,3 %
Total	3,6 %	5,4 %	4,5 %	4,9 %

*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	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	24	1696	1513	18	39	2091	2036	8	31	1156	1422						
Intragrupa y off-shore***	0	0	836	616	5	0	1344	997	0	0	848	347						
Otros	24	11	484	887	34	18	410	812	31	8	308	543						
Total	35	35	3016	3016	57	57	3846	3846	39	39	2313	2313						

* 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