

Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 11 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\$509,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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	85,1	47,5	2,3	12,0	45,0	72,9	132,4
15-35	207,3	121,2	87,5	60,0	28,5	142,1	323,3
36-60	3,1	5,7	0,0	0,5	5,7	2,6	8,8
61-90	0,2	10,9	0,1	0,0	10,9	0,2	11,1
91-180	11,7	10,5	0,1	0,0	10,4	11,7	22,2
>180	0,0	11,5	0,0	0,0	11,5	0,0	11,5
Total	307,4	207,3	89,9	72,5	112,0	229,5	509,3

* 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	5,6 %	5,1 %	4,7 %	4,8 %
15-35	4,7 %	5,2 %	5,1 %	5,1 %
36-60	-	5,8 %	4,5 %	5,4 %
61-90	-	5,6 %	4,4 %	5,6 %
91-180	-	5,5 %	4,8 %	5,2 %
>180	-	5,6 %	-	5,6 %
Total	4,7 %	5,2 %	4,9 %	5,0 %

*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

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	24	1696	1513	18	34	2262	2131	8	32	1200	1488						
Intragrupa y off-shore***	0	0	836	616	5	0	1356	1047	0	0	864	361						
Otros	24	11	484	887	29	18	492	933	32	8	359	574						
Total	35	35	3016	3016	52	52	4111	4111	40	40	2423	2423						

* 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