

Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2009
 Fecha de Información: 14 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\$725,9 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	257,2	184,3	109,2	135,5	24,9	71,6	391,3
15-35	175,7	177,5	102,0	28,0	1,5	73,7	279,2
36-60	3,0	4,6	0,0	0,0	4,6	3,0	7,6
61-90	0,4	0,6	0,0	0,2	0,6	0,2	1,1
91-180	0,4	2,3	0,0	0,3	2,3	0,1	2,8
>180	0,0	44,0	0,0	0,0	44,0	0,0	44,0
Total	436,8	413,3	211,2	164,0	77,9	148,6	725,9

* 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	4,0 %	5,2 %	4,9 %	4,7 %
15-35	5,2 %	5,1 %	4,8 %	5,0 %
36-60	-	5,1 %	4,8 %	5,0 %
61-90	-	5,7 %	4,4 %	5,3 %
91-180	-	5,5 %	3,8 %	5,4 %
>180	-	5,1 %	-	5,1 %
Total	4,7 %	5,1 %	4,8 %	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

Sectores	14 al 18 de Septiembre				21 al 25 de Septiembre				28 de Sep. al 2 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	36	2424	2259	8	32	1274	1531	7	33	1204	1526
Intragrupa y off-shore***	5	0	1455	1176	0	0	874	368	5	0	1040	377
Otros	31	19	512	956	32	8	361	610	28	7	265	607
Total	55	55	4391	4391	40	40	2509	2509	40	40	2509	2509

* 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