

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 15 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\$783,8 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	235,8	164,9	29,4	97,5	88,5	91,3	353,7
15-35	261,4	137,8	92,5	110,0	21,6	127,7	375,5
36-60	1,5	2,3	0,0	0,0	2,1	1,2	3,5
61-90	17,7	8,1	0,0	0,0	8,1	17,7	25,7
91-180	0,0	3,7	2,0	0,0	1,7	0,0	3,8
>180	0,0	21,6	4,7	0,0	16,9	0,0	21,6
Total	516,3	338,4	128,6	207,5	138,9	237,9	783,8

* 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	5,3 %	5,0 %	4,6 %	4,9 %
15-35	5,2 %	5,3 %	4,5 %	4,8 %
36-60	5,5 %	5,6 %	4,9 %	5,3 %
61-90	-	5,3 %	4,9 %	5,0 %
91-180	-	6,2 %	3,8 %	6,2 %
>180	-	5,2 %	-	5,2 %
Total	5,2 %	5,2 %	4,6 %	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	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	2475	2275	9	35	1430	1639	7	34	1261	1578
Intragrupa y off-shore***	5	0	1455	1203	0	0	903	438	5	0	1040	378
Otros	31	19	527	980	35	9	421	676	29	7	290	636
Total	56	56	4457	4457	44	44	2754	2754	41	41	2591	2591

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