

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2009
 Fecha de Información: 17 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\$992,5 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	206,2	229,8	71,6	43,1	88,0	93,0	365,8
15-35	234,5	347,6	233,4	36,3	33,2	117,1	501,1
36-60	45,0	22,6	0,0	12,0	1,2	11,6	46,2
61-90	47,5	3,4	0,0	0,0	3,4	47,5	50,9
91-180	0,5	6,2	0,0	0,0	6,2	0,5	6,7
>180	0,3	21,5	10,0	0,0	11,5	0,3	21,8
Total	534,0	631,1	315,0	91,4	143,5	270,0	992,5

* 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	4,1 %	5,3 %	4,8 %	4,8 %
15-35	6,3 %	5,3 %	4,3 %	5,1 %
36-60	5,0 %	6,0 %	4,9 %	5,0 %
61-90	-	5,5 %	4,9 %	5,0 %
91-180	-	5,3 %	4,8 %	5,3 %
>180	-	5,2 %	4,1 %	5,2 %
Total	5,2 %	5,3 %	4,6 %	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	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**	21	38	2548	2273	30	40	1755	1919	7	44	1394	1614
Intragrupa y off-shore***	5	0	1455	1276	0	1	975	563	5	0	1042	415
Otros	33	21	525	980	40	28	558	807	39	7	303	711
Total	59	59	4529	4529	70	70	3288	3288	51	51	2739	2739

* 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