

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 18 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\$717,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.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	122,3	167,7	51,6	69,0	116,1	53,3	290,0
15-35	271,5	107,9	58,8	147,0	26,2	101,5	356,4
36-60	4,9	3,4	0,0	3,0	3,4	1,9	8,2
61-90	1,2	8,1	0,0	0,0	8,1	1,2	9,3
91-180	1,7	18,9	0,0	0,0	18,9	1,6	20,6
>180	0,0	33,0	0,0	0,0	33,0	0,0	33,0
Total	401,5	339,0	110,4	219,0	205,5	159,4	717,4

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

*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**	21	38	2551	2273	30	41	1858	2006	7	47	1413	1691
Intragrupa y off-shore***	5	0	1455	1276	0	1	1000	632	5	0	1068	415
Otros	33	21	525	983	41	28	619	841	42	7	355	731
Total	59	59	4532	4532	70	70	3478	3478	54	54	2837	2837

* 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