

Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 23 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\$835,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.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	315,8	194,8	20,2	189,8	134,4	85,9	470,5
15-35	123,0	217,0	189,8	71,0	24,1	48,8	336,9
36-60	2,9	2,4	0,0	0,0	2,4	2,8	5,3
61-90	8,5	2,9	0,8	0,0	2,1	8,4	11,3
91-180	5,2	6,5	0,0	0,0	2,7	1,4	7,9
>180	0,0	3,3	0,0	0,0	3,3	0,0	3,3
Total	455,4	426,9	210,8	260,8	169,0	147,4	835,2

* 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	5,2 %	5,7 %	4,6 %	5,0 %
15-35	5,4 %	5,2 %	4,8 %	5,0 %
36-60	5,3 %	5,4 %	9,2 %	7,4 %
61-90	5,2 %	6,3 %	4,6 %	5,0 %
91-180	6,2 %	5,5 %	4,7 %	5,7 %
>180	-	5,3 %	-	5,3 %
Total	5,3 %	5,4 %	4,7 %	5,1 %

*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	21 al 25 de Septiembre				28 de Sep. al 2 de Octubre				5 al 9 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	44	2048	2075	8	49	1766	2011	41	28	1273	1436
Intragrupa y off-shore***	4	1	1015	750	5	0	1118	630	0	0	836	281
Otros	40	40	674	912	44	8	569	812	28	41	312	703
Total	85	85	3737	3737	57	57	3453	3453	70	70	2421	2421

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