

Fecha de Publicación: 6 de Octubre de 2009
 Fecha de Información: 02 de Octubre 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\$752,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	138,9	50,5	7,0	87,8	23,0	30,7	168,9
15-35	253,0	276,2	232,0	74,0	8,2	143,0	493,2
36-60	6,7	9,1	0,0	0,0	9,1	6,7	15,8
61-90	0,7	37,3	34,5	0,0	2,8	0,7	38,1
91-180	22,6	8,9	0,4	0,0	8,5	22,6	31,5
>180	0,0	5,2	1,4	0,0	3,8	0,0	5,2
Total	421,9	387,1	275,3	161,8	55,4	203,7	752,6

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

*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	28 de Sep. al 2 de Octubre				5 al 9 de Octubre				12 al 16 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	97	2277	2287	47	26	2128	2025	21	25	1064	1299
Intragrupa y off-shore***	0	0	1203	951	0	0	949	641	0	0	897	327
Otros	97	14	690	933	26	47	626	1037	25	21	204	540
Total	111	111	4171	4171	73	73	3703	3703	46	46	2165	2165

* 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