

Fecha de Publicación: 16 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 14 de Octubre de 2009¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$653,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	111,7	140,4	31,0	70,0	109,1	41,5	251,9
15-35	130,1	211,8	114,0	48,0	92,7	77,0	336,7
36-60	7,1	2,6	0,0	0,0	2,6	7,1	9,8
61-90	3,3	4,0	0,0	0,0	4,0	3,3	7,2
91-180	41,5	3,7	0,0	0,0	3,7	41,5	45,1
>180	0,5	2,0	0,0	0,0	2,0	0,5	2,5
Total	294,1	364,5	145,0	118,0	214,1	170,8	653,3

* 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	3,6 %	5,6 %	3,6 %	4,7 %
15-35	3,9 %	4,5 %	3,7 %	4,2 %
36-60	-	4,4 %	3,8 %	4,0 %
61-90	-	6,5 %	3,9 %	5,3 %
91-180	-	8,7 %	4,0 %	4,4 %
>180	-	5,0 %	4,2 %	4,8 %
Total	3,9 %	5,0 %	3,7 %	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	12 al 16 de Octubre				19 al 23 de Octubre				26 al 30 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	32	1489	1780	7	34	1542	1890	7	30	1199	1419
Intragrupo y off-shore***	0	0	1116	424	0	0	1189	557	0	0	939	411
Otros	32	25	426	828	34	7	331	616	30	7	323	631
Total	57	57	3031	3031	41	41	3062	3062	36	36	2461	2461

* 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