

Fecha de Publicación: 21 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 19 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\$849,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	142,8	219,0	60,0	70,7	159,0	72,1	361,8
15-35	184,1	290,8	191,0	44,0	35,3	75,6	410,5
36-60	52,6	1,7	0,0	0,0	1,7	52,6	54,3
61-90	2,0	0,9	0,0	0,0	0,9	2,0	2,9
91-180	15,4	4,6	0,0	0,0	3,6	14,4	19,1
>180	0,3	0,9	0,0	0,0	0,9	0,3	1,2
Total	397,3	517,9	251,0	114,7	201,4	217,1	849,8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	5,0 %	3,8 %	4,5 %
15-35	4,3 %	2,8 %	3,6 %	3,3 %
36-60	-	4,9 %	3,7 %	3,8 %
61-90	-	5,6 %	3,9 %	4,4 %
91-180	4,3 %	5,8 %	4,1 %	4,4 %
>180	-	4,5 %	4,4 %	4,5 %
Total	4,3 %	3,9 %	3,7 %	3,9 %

*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	19 al 23 de Octubre				26 al 30 de Octubre				2 al 6 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	39	1818	2139	8	45	1277	1624	2	17	1128	1324
Intragruppo y off-shore***	0	0	1244	625	0	0	1024	420	0	0	952	398
Otros	38	11	525	822	45	8	443	700	17	2	171	529
Total	49	49	3587	3587	52	52	2744	2744	19	19	2251	2251

* 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 intragruppo