

Fecha de Publicación: 22 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 20 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\$1078,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	291,1	204,2	23,2	109,7	165,6	166,1	479,9
15-35	269,1	254,8	157,5	120,0	18,9	70,7	445,5
36-60	62,2	11,9	0,0	0,0	11,9	62,2	74,1
61-90	11,9	10,2	0,0	0,0	10,2	11,9	22,1
91-180	11,6	44,6	35,0	0,0	3,4	5,4	50,0
>180	4,5	2,5	0,0	0,0	2,5	4,5	6,9
Total	650,3	528,1	215,7	229,7	212,4	320,6	1078,4

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

*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	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**	10	41	1937	2178	11	45	1399	1759	3	17	1210	1374
Intragruppo y off-shore***	0	0	1244	695	0	1	1042	421	0	0	958	438
Otros	41	10	564	871	45	10	545	805	17	3	194	551
Total	51	51	3745	3745	56	56	2986	2986	20	20	2363	2363

* 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