

Fecha de Publicación: 30 de Septiembre de 2009
Fecha de Información: 28 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\$845,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	316,0	208,9	6,5	124,0	64,4	54,0	386,9
15-35	221,4	244,3	190,0	75,4	8,2	99,9	419,6
36-60	18,6	13,0	0,0	0,0	3,0	8,5	21,6
61-90	0,6	3,0	0,0	0,0	2,9	0,6	3,6
91-180	0,6	5,5	0,0	0,0	5,5	0,6	6,1
>180	5,0	7,7	0,0	0,0	2,7	0,0	7,7
Total	562,2	482,4	196,5	199,4	86,8	163,6	845,5

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

*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	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**	13	60	2161	2254	41	28	1584	1644	12	25	937	1124
Intragrupa y off-shore***	5	0	1198	865	0	0	856	325	0	0	846	297
Otros	55	13	673	913	28	41	397	869	25	12	100	463
Total	73	73	4032	4032	70	70	2838	2838	37	37	1883	1883

* 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