

Fecha de Publicación: 1 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 29 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\$704,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	177,0	130,8	20,0	99,8	90,8	57,2	287,8
15-35	220,6	95,1	71,0	139,0	3,1	60,6	294,7
36-60	9,6	0,3	0,0	0,0	0,3	9,6	9,9
61-90	0,5	0,6	0,0	0,0	0,6	0,5	1,2
91-180	4,8	3,7	0,0	0,0	3,7	4,8	8,5
>180	10,2	96,9	35,0	0,0	56,9	5,2	102,0
Total	422,7	327,4	126,0	238,8	155,4	137,9	704,1

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

*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	102	2230	2283	41	28	1691	1683	12	25	968	1146
Intragruppo y off-shore***	5	0	1198	904	0	0	876	386	0	0	846	297
Otros	97	14	692	933	28	41	407	905	25	12	122	494
Total	116	116	4120	4120	69	69	2974	2974	37	37	1936	1936

* 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