

Fecha de Publicación: 05 de Octubre de 2009
 Fecha de Información: 01 de Octubre 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\$1391,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.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	259,1	305,6	96,7	129,2	168,9	89,9	524,7
15-35	326,1	548,3	442,3	169,5	27,0	77,6	795,4
36-60	3,9	10,1	10,0	0,4	0,1	3,6	14,1
61-90	29,0	3,2	1,9	0,0	1,2	29,0	32,1
91-180	20,1	5,2	0,0	0,0	5,2	20,1	25,3
>180	0,2	0,1	0,0	0,0	0,1	0,2	0,3
Total	638,5	872,5	550,8	299,1	202,6	220,4	1391,9

* 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	5,6 %	4,7 %	6,4 %	5,6 %
15-35	4,7 %	5,2 %	4,6 %	5,0 %
36-60	-	4,5 %	3,9 %	4,3 %
61-90	-	5,3 %	4,5 %	4,6 %
91-180	-	5,0 %	4,6 %	4,7 %
>180	-	5,2 %	4,7 %	4,9 %
Total	5,0 %	5,1 %	5,4 %	5,2 %

*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

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	2277	2282	47	27	2042	1998	15	25	1018	1274
Intragrupa y off-shore***	5	0	1198	951	0	0	942	573	0	0	897	307
Otros	97	14	690	933	27	47	606	1019	25	15	200	533
Total	117	117	4166	4166	74	74	3590	3590	41	41	2114	2114

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo