

Fecha de Publicación: 7 de Octubre de 2009
 Fecha de Información: 05 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\$808,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	119,3	322,6	90,8	34,3	221,3	74,6	431,4
15-35	193,2	113,9	78,5	87,0	1,3	72,2	273,1
36-60	69,8	0,1	0,0	0,0	0,1	69,8	69,8
61-90	22,7	0,2	0,0	0,0	0,2	22,7	22,9
91-180	9,9	0,5	0,0	0,0	0,5	9,9	10,4
>180	0,0	1,0	0,0	0,0	1,0	0,0	1,0
Total	414,9	438,2	169,3	121,3	224,5	249,1	808,6

* 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	4,7 %	34,4 %	4,2 %	24,6 %
15-35	4,1 %	5,3 %	4,5 %	4,6 %
36-60	-	6,1 %	3,9 %	3,9 %
61-90	-	4,9 %	4,4 %	4,5 %
91-180	-	5,8 %	4,5 %	4,6 %
>180	-	5,0 %	-	5,0 %
Total	4,3 %	28,6 %	4,3 %	14,2 %

*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	5 al 9 de Octubre				12 al 16 de Octubre				19 al 23 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	184	2227	2144	21	25	1114	1336	6	26	1220	1528
Intragrupo y off-shore***	0	0	1040	673	0	0	897	329	0	0	1066	498
Otros	183	11	653	1103	25	21	232	578	25	6	190	451
Total	194	194	3920	3920	46	46	2242	2242	31	31	2477	2477

* 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