

Fecha de Publicación: 14 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 09 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\$639,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	70,0	188,1	126,6	0,0	31,2	39,6	227,8
15-35	115,5	155,2	87,5	36,3	44,3	55,7	247,3
36-60	4,7	13,4	0,0	0,0	13,4	4,7	18,1
61-90	65,0	46,7	10,0	20,0	6,7	15,0	81,7
91-180	45,6	10,7	0,0	0,0	10,7	45,6	56,2
>180	3,4	5,1	0,0	0,0	5,1	3,4	8,5
Total	304,2	419,2	224,1	56,3	111,3	164,1	639,6

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

*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**	10	184	2314	2248	25	31	1415	1751	7	31	1441	1699
Intragrupa y off-shore***	0	0	1108	723	0	0	1116	375	0	0	1112	521
Otros	183	10	675	1125	31	25	398	803	31	7	228	561
Total	194	194	4096	4096	56	56	2929	2929	38	38	2780	2780

* 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