

Fecha de Publicación: 15 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 13 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\$682,1 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	65,6	150,8	68,0	15,0	72,2	40,0	205,8
15-35	237,1	168,5	116,0	16,0	5,3	174,0	358,5
36-60	21,7	1,0	0,0	0,0	0,9	21,7	22,6
61-90	16,2	3,8	0,0	0,0	3,8	16,1	19,9
91-180	46,8	5,1	0,0	0,0	5,1	46,8	51,9
>180	9,0	14,4	10,0	0,0	4,4	9,0	23,3
Total	396,3	343,5	194,0	31,0	91,7	307,6	682,1

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

Sectores	12 al 16 de Octubre				19 al 23 de Octubre				26 al 30 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	31	1454	1773	7	33	1472	1815	7	30	1177	1299
Intragrupa y off-shore***	0	0	1116	390	0	0	1170	521	0	0	923	411
Otros	31	25	419	827	33	7	276	582	30	7	219	608
Total	56	56	2989	2989	40	40	2918	2918	37	37	2319	2319

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