

Fecha de Publicación: 19 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 15 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\$880,1 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	108,5	103,1	64,9	14,2	38,2	94,3	211,5
15-35	182,1	448,5	381,6	10,0	20,6	125,8	584,3
36-60	16,7	7,6	3,0	0,0	4,6	16,7	24,4
61-90	12,9	6,5	0,0	0,0	6,5	12,9	19,4
91-180	25,7	5,3	0,0	0,0	5,3	25,7	31,0
>180	3,0	6,6	0,0	0,0	6,6	3,0	9,6
Total	348,9	577,5	449,5	24,2	81,7	278,4	880,1

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

Sector	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	32	1500	1780	7	34	1635	1982	7	32	1206	1444
Intragrupa y off-shore***	0	0	1116	435	0	0	1244	560	0	0	949	411
Otros	32	25	427	828	34	7	369	706	32	7	339	637
Total	57	57	3043	3043	41	41	3248	3248	39	39	2493	2493

* 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