

Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 16 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\$1022,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	107,2	133,8	15,1	4,0	117,9	102,5	240,2
15-35	368,7	362,5	303,0	30,5	7,0	285,7	678,7
36-60	9,5	2,2	0,0	0,0	2,2	9,5	11,7
61-90	11,3	5,2	0,0	0,0	5,2	11,3	16,4
91-180	5,0	48,8	10,0	0,0	38,8	5,0	53,9
>180	0,0	21,7	0,0	0,0	21,7	0,0	21,7
Total	501,6	574,2	328,1	34,5	192,9	413,9	1022,6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,9 %	4,0 %	3,5 %	3,8 %
15-35	3,4 %	4,8 %	1,4 %	2,6 %
36-60	-	4,9 %	3,9 %	4,1 %
61-90	-	5,5 %	4,0 %	4,5 %
91-180	-	4,7 %	4,1 %	4,6 %
>180	-	4,7 %	-	4,7 %
Total	3,5 %	4,5 %	2,0 %	3,2 %

*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	1799	7	38	1730	2058	7	45	1227	1486
Intragruppo y off-shore***	0	0	1133	435	0	0	1244	564	0	0	964	411
Otros	32	25	428	828	38	7	444	796	45	7	366	659
Total	57	57	3061	3061	45	45	3418	3418	51	51	2557	2557

* 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 intragruppo