

Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 22 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\$1259,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	252,7	296,2	233,8	171,3	62,5	81,4	548,9
15-35	221,8	441,2	387,6	93,0	11,1	86,3	620,5
36-60	16,8	15,0	15,0	0,0	0,0	16,8	31,8
61-90	29,9	1,0	0,0	0,0	1,0	29,9	30,9
91-180	4,3	11,2	10,0	0,0	1,2	4,3	15,6
>180	11,2	0,3	0,0	0,0	0,3	11,2	11,5
Total	536,6	765,0	646,4	264,3	76,2	229,8	1259,1

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

*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	19 al 23 de Octubre				26 al 30 de Octubre				2 al 6 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	44	1986	2213	9	48	1674	2124	3	17	1407	1424
Intragrupa y off-shore***	0	0	1281	744	0	1	1277	560	0	0	1003	532
Otros	44	11	562	871	48	8	670	936	17	3	201	654
Total	55	55	3829	3829	57	57	3621	3621	21	21	2610	2610

* 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