

Fecha de Publicación: 28 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 26 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\$508,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	90,4	51,9	3,0	35,5	48,9	54,9	142,3
15-35	147,1	211,9	145,0	1,8	36,9	115,3	329,0
36-60	1,6	6,4	5,0	0,0	1,4	1,6	8,1
61-90	7,4	2,4	0,0	0,0	2,4	7,4	9,8
91-180	9,8	0,8	0,0	0,0	0,8	9,8	10,7
>180	7,7	6,3	0,0	0,0	1,3	2,7	9,0
Total	264,1	279,8	153,0	37,3	91,8	191,8	508,9

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

*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	26 al 30 de Octubre				2 al 6 de Noviembre				9 al 13 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	48	1752	2270	5	18	1531	1518	9	20	1070	1216
Intragrupa y off-shore***	0	1	1363	581	0	0	1013	607	0	0	831	163
Otros	48	12	729	993	17	5	284	703	20	9	158	680
Total	61	61	3844	3844	22	22	2828	2828	29	29	2058	2058

* 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