

Fecha de Publicación: 30 de Octubre de 2009
Fecha de Información: 28 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\$926,6 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	116,7	230,0	154,5	11,0	70,5	100,7	341,7
15-35	253,6	315,0	242,3	100,9	17,2	97,2	513,1
36-60	25,3	6,7	5,8	0,0	0,9	25,3	32,0
61-90	11,0	5,9	0,0	0,0	5,9	11,0	17,0
91-180	8,9	0,5	0,0	0,0	0,5	8,9	9,4
>180	10,1	3,4	0,0	0,0	3,4	10,1	13,5
Total	425,7	561,4	402,5	111,9	98,4	253,3	926,6

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

Sectores	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**	14	35	1879	2365	6	17	1726	1913	12	20	1165	1267
Intragrupa y off-shore***	0	1	1396	672	0	0	1227	624	0	0	871	190
Otros	35	13	790	1029	17	6	440	856	20	12	159	738
Total	49	49	4065	4065	24	24	3393	3393	32	32	2194	2194

* 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