

Fecha de Publicación: 6 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 04 de Noviembre de 2009 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$761,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	103,7	194,2	93,1	28,3	76,1	50,4	272,8
15-35	159,9	266,9	187,5	32,0	39,4	87,9	386,8
36-60	3,6	7,9	0,0	0,0	7,9	3,6	11,5
61-90	23,0	3,9	0,0	0,0	3,9	23,0	26,9
91-180	55,1	7,5	0,0	0,0	7,5	55,0	62,5
>180	0,2	0,4	0,0	0,0	0,4	0,2	0,6
Total	345,4	480,7	280,6	60,3	135,1	220,1	761,1

* 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	2,9 %	3,0 %	2,7 %	2,9 %
15-35	3,2 %	3,6 %	2,9 %	3,3 %
36-60	-	3,2 %	2,6 %	3,0 %
61-90	-	4,6 %	3,2 %	3,4 %
91-180	2,7 %	4,8 %	3,0 %	3,2 %
>180	-	4,0 %	3,5 %	3,9 %
Total	3,1 %	3,5 %	2,9 %	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	2 al 6 de Noviembre				9 al 13 de Noviembre				16 al 20 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	18	2006	2387	16	21	1437	1828	9	33	1320	1435
Intragrupa y off-shore***	0	0	1485	728	0	0	1280	279	0	0	1024	503
Otros	18	7	626	1001	21	16	285	896	33	9	165	571
Total	25	25	4116	4116	37	37	3003	3003	42	42	2509	2509

* 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