

Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 06 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\$618,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	74,6	192,6	138,0	2,0	54,6	72,6	267,2
15-35	170,1	193,7	99,8	88,3	54,9	42,9	324,8
36-60	2,1	9,3	9,0	0,0	0,3	2,1	11,4
61-90	5,6	0,9	0,0	0,0	0,9	5,6	6,5
91-180	5,9	6,9	0,0	0,0	1,9	0,9	7,8
>180	0,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,3	0,3
Total	258,6	403,3	246,8	90,3	112,5	124,4	618,0

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

*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	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**	8	18	2022	2402	20	21	1527	2180	8	34	1421	1476
Intragrupa y off-shore***	0	0	1485	730	0	0	1560	291	0	0	1037	541
Otros	18	8	626	1002	21	20	358	974	34	8	193	634
Total	26	26	4133	4133	41	41	3445	3445	41	41	2651	2651

* 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