

Fecha de Publicación: 03 de Noviembre de 2009

Fecha de Información: 29 de Octubre 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\$1129,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	169,0	253,5	140,0	92,1	113,3	76,6	422,2
15-35	313,9	237,9	207,2	209,4	8,7	82,5	529,8
36-60	9,8	104,3	91,0	0,0	13,3	9,8	114,1
61-90	33,3	8,3	0,0	0,0	8,3	33,3	41,6
91-180	1,6	17,1	0,0	0,0	17,1	1,6	18,7
>180	2,3	0,5	0,0	0,0	0,5	2,3	2,8
Total	529,9	621,6	438,2	301,5	161,1	206,1	1129,2

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

*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	36	1879	2364	6	18	1814	2155	12	19	1250	1279
Intragrupa y off-shore***	0	1	1396	672	0	0	1363	654	0	0	875	252
Otros	36	13	790	1029	18	6	546	914	19	12	167	760
Total	50	50	4065	4065	24	24	3723	3723	31	31	2291	2291

* 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