

Fecha de Publicación: 4 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 30 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\$981,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	154,6	320,2	274,0	71,9	16,2	52,7	444,9
15-35	153,1	289,9	199,0	59,0	79,0	82,2	431,1
36-60	13,2	8,1	0,0	0,0	8,1	13,2	21,3
61-90	35,9	0,1	0,0	0,0	0,1	35,9	35,9
91-180	7,7	24,3	15,0	0,0	9,3	7,7	31,9
>180	9,9	6,2	0,0	7,0	6,2	2,9	16,1
Total	374,4	648,8	488,0	137,9	118,9	194,6	981,3

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

*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**	14	36	1879	2366	7	17	1947	2273	13	19	1269	1481
Intragrupa y off-shore***	0	1	1396	672	0	0	1437	719	0	0	1075	258
Otros	36	13	791	1029	17	7	560	951	19	13	169	773
Total	50	50	4066	4066	25	25	3944	3944	32	32	2513	2513

* 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