

Fecha de Publicación: 5 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 03 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\$1093,0 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	154,7	249,0	133,5	11,1	105,6	133,6	393,7
15-35	230,2	412,1	373,8	148,0	11,3	55,2	615,2
36-60	36,1	8,8	8,0	0,0	0,8	36,1	44,9
61-90	4,7	8,0	8,0	0,0	0,0	4,7	12,7
91-180	14,4	0,3	0,0	0,0	0,3	14,4	14,7
>180	6,5	6,3	1,4	0,0	3,7	5,3	11,7
Total	446,6	684,6	524,7	159,1	121,7	249,3	1093,0

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

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	17	2006	2371	16	19	1355	1665	9	33	1293	1406
Intragrupa y off-shore***	0	0	1470	727	0	0	1206	262	0	0	1021	493
Otros	17	7	625	1002	19	16	212	846	33	9	156	570
Total	24	24	4100	4100	36	36	2773	2773	42	42	2469	2469

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo