

Fecha de Publicación: 09 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 05 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\$801,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	122,0	215,2	154,6	49,8	46,1	57,6	322,7
15-35	229,9	242,5	168,5	76,7	12,5	91,7	410,9
36-60	12,9	4,8	0,0	0,0	4,8	12,9	17,7
61-90	10,8	25,8	25,0	0,0	0,8	10,8	36,6
91-180	12,0	1,1	0,0	0,0	1,1	12,0	13,1
>180	0,1	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1	0,2
Total	387,7	489,5	348,1	126,5	65,4	185,1	801,1

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

*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**	8	18	2022	2402	16	21	1480	2007	8	33	1398	1456
Intragrupa y off-shore***	0	0	1485	730	0	0	1432	291	0	0	1027	539
Otros	18	8	626	1001	21	16	313	926	33	8	183	612
Total	26	26	4133	4133	37	37	3225	3225	41	41	2607	2607

* 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