

Fecha de Publicación: 12 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 10 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\$759,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	228,6	150,4	74,4	136,0	46,0	62,6	349,0
15-35	165,3	238,0	162,5	45,0	16,5	61,3	344,2
36-60	1,4	18,5	16,2	0,0	2,3	1,4	19,9
61-90	21,5	0,7	0,0	0,0	0,7	21,5	22,2
91-180	18,9	16,2	0,0	0,0	5,4	8,1	24,2
>180	0,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,4	0,4
Total	435,9	423,8	253,1	181,0	70,9	155,1	759,9

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,5 %	3,5 %	3,0 %	3,2 %
15-35	2,9 %	3,4 %	2,9 %	3,1 %
36-60	-	3,5 %	2,0 %	3,4 %
61-90	-	5,1 %	3,1 %	3,1 %
91-180	3,0 %	3,9 %	3,3 %	3,3 %
>180	-	-	3,9 %	3,9 %
Total	3,1 %	3,5 %	3,0 %	3,2 %

*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	9 al 13 de Noviembre				16 al 20 de Noviembre				23 al 27 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	22	1737	2255	13	34	1610	1654	10	28	1318	1750
Intragruppo y off-shore***	0	0	1567	452	0	0	1143	643	0	0	1287	297
Otros	22	19	421	1018	34	13	229	685	28	10	277	836
Total	41	41	3724	3724	47	47	2983	2983	38	38	2882	2882

* 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 intragruppo