

Fecha de Publicación: 13 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 11 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\$409,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	68,5	50,8	49,0	57,0	1,8	11,5	119,4
15-35	128,6	141,0	82,7	44,7	30,3	55,9	241,5
36-60	2,3	1,4	0,0	0,0	1,4	2,3	3,7
61-90	24,6	21,5	0,0	0,0	1,5	4,6	26,1
91-180	15,0	2,5	0,0	0,0	2,5	15,0	17,5
>180	0,1	0,6	0,0	0,0	0,6	0,1	0,8
Total	239,2	217,8	131,7	101,7	38,1	89,5	409,0

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

*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	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**	20	23	1762	2257	14	34	1646	1655	9	28	1323	1796
Intragrupa y off-shore***	0	0	1570	477	0	0	1143	672	0	0	1333	300
Otros	23	20	420	1018	34	14	231	693	28	9	277	837
Total	43	43	3751	3751	49	49	3020	3020	37	37	2933	2933

* 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