

Fecha de Publicación: 20 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 18 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\$1351,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	202,7	498,9	415,0	98,5	43,9	64,2	661,6
15-35	255,7	421,4	264,0	106,0	60,4	52,7	580,1
36-60	14,7	26,3	13,0	0,0	3,3	4,7	31,1
61-90	15,3	7,6	0,0	0,0	7,6	15,3	23,0
91-180	35,0	4,6	0,0	0,0	4,6	35,0	39,6
>180	0,0	16,5	16,2	0,0	0,3	0,0	16,5
Total	523,5	975,4	708,2	204,5	120,2	172,0	1351,9

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-0,6 %	3,6 %	3,2 %	2,8 %
15-35	2,1 %	3,7 %	3,2 %	3,3 %
36-60	3,8 %	3,5 %	3,1 %	3,5 %
61-90	-	3,8 %	3,1 %	3,3 %
91-180	-	4,0 %	3,2 %	3,3 %
>180	-	3,7 %	-	3,7 %
Total	1,4 %	3,7 %	3,2 %	3,1 %

*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	16 al 20 de Noviembre				23 al 27 de Noviembre				30 de Nov. al 4 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	34	1844	1781	13	31	1818	2702	5	33	1497	1834
Intragrupa y off-shore***	0	0	1206	785	0	0	2113	566	0	0	1242	558
Otros	34	18	294	778	31	13	353	1017	33	5	241	588
Total	52	52	3345	3345	44	44	4285	4285	37	37	2980	2980

* 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