

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 20 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\$485,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	130,4	34,2	15,0	55,7	19,2	74,7	164,6
15-35	144,6	139,8	132,5	26,2	2,8	113,9	279,9
36-60	5,1	8,1	7,5	0,0	0,6	5,1	13,2
61-90	13,2	5,1	5,0	0,0	0,1	13,2	18,3
91-180	1,3	3,9	0,0	0,0	3,9	1,3	5,3
>180	0,2	4,0	0,0	0,0	4,0	0,2	4,2
Total	294,7	195,2	160,0	81,9	30,7	208,3	485,4

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

Sectores	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	38	1849	1799	11	34	2094	2776	6	27	1565	1876
Intragrupa y off-shore***	0	0	1216	789	0	0	2114	673	0	2	1261	573
Otros	38	18	301	778	34	11	396	1155	27	4	254	631
Total	57	57	3367	3367	45	45	4603	4603	34	34	3081	3081

* 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