

Fecha de Publicación: 1 de Diciembre de 2009
 Fecha de Información: 27 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\$679,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	89,5	94,2	56,0	36,5	38,2	53,0	183,7
15-35	224,9	218,2	79,5	40,0	60,2	106,4	364,6
36-60	59,4	10,4	0,0	0,0	5,4	54,4	64,8
61-90	11,2	0,7	0,0	0,0	0,7	11,2	11,9
91-180	36,3	16,8	8,8	0,0	5,7	34,0	50,8
>180	4,1	0,0	0,0	0,0	0,0	4,1	4,1
Total	425,4	340,3	144,3	76,5	110,2	263,1	679,9

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

*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	23 al 27 de Noviembre				30 de Nov. al 4 de Diciembre				7 al 11 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	41	2301	2809	12	26	1961	2095	9	16	1032	1389
Intragrupa y off-shore***	0	0	2142	826	0	2	1353	807	0	0	943	286
Otros	41	12	401	1209	26	10	375	787	16	9	288	587
Total	53	53	4844	4844	38	38	3689	3689	25	25	2263	2263

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo