

Fecha de Publicación: 27 de Noviembre de 2009
Fecha de Información: 25 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\$1015,8 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	112,4	30,7	3,0	42,0	27,7	70,4	143,1
15-35	207,7	520,5	441,5	27,6	33,0	134,1	682,2
36-60	39,0	79,7	71,5	0,0	8,2	39,0	118,6
61-90	22,6	0,4	0,0	3,7	0,4	18,8	23,0
91-180	43,7	4,9	0,0	0,0	4,9	43,7	48,6
>180	0,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,2	0,2
Total	425,6	636,2	516,0	73,3	74,2	306,3	1015,8

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

Sector	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	38	2257	2809	9	29	1897	2016	9	16	973	1312
Intragrupa y off-shore***	0	0	2142	817	0	2	1331	771	0	0	888	285
Otros	38	12	401	1174	28	7	318	759	16	9	265	529
Total	50	50	4800	4800	37	37	3545	3545	25	25	2126	2126

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo