

Fecha de Publicación: 28 de Noviembre de 2009
 Fecha de Información: 26 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\$242,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	44,5	63,8	21,0	9,0	42,8	35,5	108,3
15-35	55,4	47,8	31,0	20,0	1,8	20,4	88,2
36-60	15,4	0,1	0,0	0,0	0,1	15,4	15,4
61-90	12,9	0,0	0,0	0,0	0,0	12,9	13,0
91-180	10,9	0,5	0,0	0,0	0,5	10,9	11,4
>180	2,6	3,9	0,0	0,0	3,9	2,6	6,5
Total	141,6	116,1	52,0	29,0	49,1	97,6	242,7

* 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	-	3,3 %	5,5 %	4,2 %
15-35	3,3 %	3,5 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,6 %	2,7 %	2,7 %
61-90	-	3,5 %	2,9 %	2,9 %
91-180	-	3,8 %	2,9 %	3,0 %
>180	-	3,5 %	3,2 %	3,4 %
Total	3,3 %	3,4 %	3,8 %	3,6 %

*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	2266	2809	10	26	1905	2079	9	16	1001	1312
Intragrupa y off-shore***	0	0	2142	826	0	2	1352	771	0	0	888	285
Otros	41	12	401	1174	26	8	359	767	16	9	265	557
Total	53	53	4809	4809	35	35	3616	3616	25	25	2154	2154

* 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