

Fecha de Publicación: 4 de Diciembre de 2009
 Fecha de Información: 02 de Diciembre 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\$634,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	104,2	15,0	0,0	69,0	15,0	35,2	119,2
15-35	170,8	207,4	108,0	67,3	37,4	41,5	316,2
36-60	50,2	42,1	40,0	4,0	2,1	46,2	92,3
61-90	30,3	58,2	57,0	0,0	1,2	30,3	88,5
91-180	2,4	4,9	0,0	0,0	4,9	2,4	7,2
>180	8,1	3,0	0,0	5,0	3,0	3,1	11,1
Total	365,9	330,6	205,0	145,3	63,6	158,6	634,5

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

*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	30 de Nov. al 4 de Diciembre				7 al 11 de Diciembre				14 al 18 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	26	2173	2138	12	17	1144	1501	16	33	1310	1683
Intragrupa y off-shore***	0	2	1370	987	0	1	981	346	0	0	1161	243
Otros	26	11	401	819	17	11	361	640	33	16	252	798
Total	39	39	3944	3944	29	29	2486	2486	49	49	2723	2723

* 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