

Fecha de Publicación: 10 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 07 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\$470,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	39,2	159,6	118,8	13,5	40,8	25,7	198,7
15-35	82,1	144,5	114,0	41,0	0,5	11,1	196,6
36-60	18,5	17,9	7,0	0,0	10,9	18,5	36,5
61-90	11,1	0,8	0,0	10,0	0,8	1,1	11,9
91-180	6,6	7,9	5,0	0,0	2,9	6,6	14,5
>180	2,6	10,1	10,0	0,0	0,1	2,6	12,7
Total	160,2	340,6	254,8	64,5	55,9	65,7	470,8

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

*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

Sector	7 al 11 de Diciembre				14 al 18 de Diciembre				21 al 25 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	17	1278	1709	24	36	1612	1908	77	19	538	973
Intragrupa y off-shore***	0	1	1128	422	3	0	1292	432	0	0	720	105
Otros	17	15	423	698	32	24	311	874	19	77	90	270
Total	33	33	2829	2829	60	60	3215	3215	97	97	1348	1348

* 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