

Fecha de Publicación: 11 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 09 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\$817,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	174,4	147,2	50,3	103,7	71,9	45,7	296,6
15-35	112,6	240,2	187,5	65,0	17,7	12,6	317,8
36-60	31,1	74,9	64,0	0,0	10,9	31,1	105,9
61-90	55,4	1,0	0,0	32,0	1,0	23,4	56,4
91-180	16,3	19,5	17,0	0,0	2,5	16,3	35,8
>180	5,5	0,0	0,0	0,0	0,0	5,5	5,6
Total	395,2	482,7	318,8	200,7	103,9	134,5	817,9

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

*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**	15	18	1280	1710	50	36	1676	2015	77	19	622	1010
Intragrupa y off-shore***	0	1	1130	423	3	24	1337	451	0	0	723	164
Otros	18	14	421	698	33	26	359	905	19	77	114	285
Total	33	33	2831	2831	86	86	3371	3371	97	97	1459	1459

* 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