

Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 10 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\$1138,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	432,1	68,7	9,2	354,3	34,5	52,8	475,8
15-35	309,3	258,2	163,3	98,5	21,9	137,8	494,5
36-60	30,2	18,2	0,0	0,0	18,2	30,2	48,4
61-90	4,3	7,7	0,0	0,0	7,7	4,3	12,1
91-180	16,1	25,5	23,0	0,0	2,5	16,1	41,6
>180	26,5	50,0	20,0	0,0	20,0	16,5	66,5
Total	818,6	428,3	215,5	452,8	104,8	257,8	1138,9

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,5 %	2,1 %	1,9 %	1,8 %
15-35	1,2 %	3,0 %	1,8 %	2,1 %
36-60	-	2,8 %	2,3 %	2,5 %
61-90	-	3,6 %	2,2 %	3,1 %
91-180	-	3,0 %	2,5 %	2,9 %
>180	3,0 %	3,1 %	2,2 %	2,9 %
Total	1,2 %	2,9 %	2,0 %	2,2 %

*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	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	19	1503	1708	50	39	1936	2078	2	19	646	1016
Intragruppo y off-shore***	0	1	1130	646	3	24	1341	579	0	0	728	168
Otros	19	14	420	698	36	26	392	1012	19	2	115	305
Total	35	35	3053	3053	89	89	3668	3668	22	22	1489	1489

* 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 intragruppo