

Fecha de Publicación: 15 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 11 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\$669,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	160,7	45,1	10,9	126,5	20,2	20,2	191,8
15-35	264,5	228,6	114,0	94,8	26,6	81,7	405,1
36-60	4,4	10,9	0,0	0,0	10,9	4,4	15,4
61-90	38,8	40,8	0,0	0,0	5,8	3,8	44,6
91-180	5,4	4,0	0,0	0,0	4,0	5,4	9,4
>180	2,4	3,3	0,0	0,0	1,3	0,4	3,6
Total	476,2	332,6	124,9	221,3	68,7	116,0	669,9

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

*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

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**	14	19	1498	1713	50	39	2060	2116	3	20	685	1017
Intragrupa y off-shore***	0	1	1130	646	3	24	1352	667	0	0	728	206
Otros	19	13	424	694	36	26	405	1035	20	3	116	306
Total	34	34	3053	3053	89	89	3817	3817	23	23	1529	1529

* 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