

Fecha de Publicación: 21 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 17 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\$983,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,1%.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	201,2	82,4	10,0	118,0	28,4	39,2	239,6
15-35	174,5	422,6	242,6	7,0	103,7	91,2	520,7
36-60	26,7	75,1	61,0	0,0	14,1	26,7	101,7
61-90	68,6	13,3	5,0	0,0	8,3	68,6	81,9
91-180	18,8	8,5	0,0	0,0	8,5	18,8	27,2
>180	7,4	4,4	0,0	0,0	4,4	7,4	11,8
Total	497,1	606,2	318,6	125,0	167,3	251,8	983,0

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

*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	14 al 18 de Diciembre				21 al 25 de Diciembre				28 de Dic. al 1 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	42	2327	2259	7	24	926	1078	8	25	1094	1125
Intragruppo y off-shore***	3	24	1463	872	0	0	739	339	0	0	713	553
Otros	38	27	417	1056	23	7	155	403	25	8	119	249
Total	92	92	4207	4187	30	30	1820	1820	33	33	1927	1927

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo