

Fecha de Publicación: 23 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 21 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\$464,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,3%.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	78,4	60,6	34,6	46,5	6,0	11,9	119,0
15-35	126,8	183,5	97,2	12,9	35,4	62,9	259,4
36-60	28,0	1,4	0,0	0,0	1,4	28,0	29,4
61-90	22,5	7,3	1,0	5,0	6,3	17,5	29,9
91-180	6,9	11,8	9,0	0,0	2,8	6,9	18,6
>180	8,0	0,6	0,0	0,0	0,6	8,0	8,6
Total	270,6	265,3	141,8	64,4	52,6	135,2	464,9

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

*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	21 al 25 de Diciembre				28 de Dic. al 1 de Enero				4 al 8 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	24	1001	1102	12	25	1156	1195	4	13	931	1489
Intragrupa y off-shore***	0	0	741	391	0	0	761	580	0	0	1091	127
Otros	24	7	177	426	25	12	121	264	13	4	145	552
Total	31	31	1919	1919	36	36	2039	2039	17	17	2168	2168

* 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