

Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 23 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\$522,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,1%.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	8,7	14,6	1,3	0,0	13,3	8,7	23,3
15-35	132,5	320,9	245,5	13,5	7,4	51,0	385,4
36-60	10,8	15,3	11,0	0,0	4,3	10,8	26,1
61-90	63,1	15,2	7,0	10,8	7,2	51,4	77,4
91-180	2,9	3,4	0,0	0,0	3,4	2,9	6,3
>180	2,0	3,6	0,0	0,0	1,6	0,0	3,6
Total	220,1	373,0	264,8	24,3	37,2	124,8	522,1

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

Sector	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**	6	27	1019	1102	7	25	1174	1230	5	13	947	1535
Intragrupa y off-shore***	0	0	741	408	0	0	771	581	0	0	1138	132
Otros	27	6	177	427	25	7	148	281	13	5	144	562
Total	33	33	1936	1936	32	32	2092	2092	17	17	2229	2229

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo