

Fecha de Publicación: 30 de Diciembre de 2009
Fecha de Información: 28 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\$178,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,6%.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	35,5	5,0	5,0	2,0	0,0	33,5	40,5
15-35	12,9	70,0	40,5	3,0	24,5	4,9	77,9
36-60	12,3	0,5	0,0	0,0	0,5	12,3	12,8
61-90	24,6	0,4	0,0	0,0	0,4	24,6	25,0
91-180	9,6	10,2	0,0	0,0	10,2	9,6	19,8
>180	1,4	1,5	0,0	0,0	1,5	1,4	3,0
Total	96,3	87,7	45,5	5,0	37,2	86,3	178,9

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

*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	28 de Dic. al 1 de Enero				4 al 8 de Enero				11 al 15 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	23	1177	1237	5	13	981	1537	11	30	1387	1359
Intragrupa y off-shore***	0	0	776	583	0	0	1140	132	0	0	817	312
Otros	23	7	150	283	13	5	144	597	30	11	287	821
Total	30	30	2102	2102	18	18	2265	2265	41	41	2492	2492

* 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