

Fecha de Publicación: 04 de Enero de 2010
Fecha de Información: 29 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\$506,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,0%.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	79,5	85,3	20,0	0,0	5,3	19,5	104,8
15-35	96,1	144,1	88,9	39,0	9,2	11,1	194,2
36-60	101,4	79,0	0,0	0,0	9,0	31,4	110,3
61-90	40,8	33,1	32,0	0,0	1,1	40,8	73,9
91-180	0,3	5,8	5,0	0,0	0,8	0,3	6,1
>180	4,5	15,8	7,0	0,0	5,8	1,5	17,3
Total	322,6	363,0	152,9	39,0	31,2	104,6	506,7

* 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 %	0,1 %	-3,7 %	-0,7 %
15-35	-0,1 %	-0,2 %	-0,8 %	-0,3 %
36-60	0,6 %	0,4 %	0,1 %	0,4 %
61-90	-	3,0 %	0,2 %	0,3 %
91-180	-	0,3 %	-0,1 %	0,3 %
>180	2,4 %	3,2 %	3,3 %	3,1 %
Total	0,2 %	0,2 %	-0,7 %	0,0 %

*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	1178	1237	7	13	1047	1622	11	30	1454	1394
Intragrupa y off-shore***	0	0	776	584	0	0	1160	131	0	0	827	336
Otros	23	7	150	283	13	7	149	603	30	11	287	838
Total	30	30	2104	2104	20	20	2356	2356	41	41	2568	2568

* 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