

Fecha de Publicación: 6 de Enero de 2010
Fecha de Información: 04 de Enero de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$883,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	211,8	141,3	56,5	139,5	24,8	12,3	293,0
15-35	291,3	258,8	172,0	186,7	35,8	53,6	499,1
36-60	4,4	24,6	14,5	0,0	10,1	4,4	29,0
61-90	5,2	30,0	24,5	0,0	0,5	0,2	30,2
91-180	16,5	12,8	5,0	0,0	7,8	16,5	29,3
>180	0,1	2,6	0,0	0,0	2,6	0,1	2,8
Total	529,2	470,1	272,5	326,2	81,6	87,0	883,3

* 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 %	0,8 %	-0,1 %	0,2 %
15-35	0,2 %	0,1 %	-0,3 %	-0,1 %
36-60	-	0,6 %	0,0 %	0,5 %
61-90	0,5 %	1,7 %	0,3 %	1,5 %
91-180	-	2,9 %	1,9 %	2,2 %
>180	-	2,7 %	2,4 %	2,7 %
Total	0,1 %	0,5 %	-0,1 %	0,2 %

*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	4 al 8 de Enero				11 al 15 de Enero				18 al 22 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	14	1219	1675	13	30	1508	1484	5	59	794	970
Intragrupa y off-shore***	0	0	1177	259	0	0	867	351	0	0	623	219
Otros	14	7	156	618	30	13	307	847	59	5	203	431
Total	21	21	2552	2552	43	43	2682	2682	64	64	1620	1620

* 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