

Fecha de Publicación: 8 de Enero de 2010
Fecha de Información: 05 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\$994,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	172,0	171,5	145,0	78,0	16,5	84,0	333,5
15-35	282,5	302,7	119,0	61,0	72,7	110,5	474,1
36-60	96,8	39,8	0,1	25,0	14,8	46,8	111,7
61-90	14,8	22,4	10,1	0,0	2,4	4,8	27,3
91-180	12,6	11,9	10,0	0,0	1,9	12,6	24,5
>180	23,0	0,1	0,0	0,0	0,1	23,0	23,1
Total	601,7	548,5	284,1	164,0	108,4	281,7	994,2

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	-0,4 %	-0,9 %	-0,7 %
15-35	0,1 %	0,3 %	-0,3 %	0,1 %
36-60	1,4 %	1,6 %	0,7 %	1,0 %
61-90	1,4 %	1,2 %	0,7 %	1,2 %
91-180	-	3,0 %	1,2 %	1,4 %
>180	-	3,8 %	3,0 %	3,0 %
Total	0,4 %	0,2 %	-0,1 %	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	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**	9	14	1312	1683	15	30	1550	1646	9	60	878	981
Intragruppo y off-shore***	0	0	1177	337	0	0	1012	351	0	0	623	220
Otros	14	9	164	633	30	15	314	879	60	9	207	507
Total	23	23	2653	2653	45	45	2876	2876	69	69	1708	1708

* 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 intragruppo