

Fecha de Publicación: 8 de Enero de 2010
Fecha de Información: 06 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\$1036,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	207,1	102,1	35,0	138,5	25,1	26,6	267,2
15-35	289,4	299,3	189,9	129,5	56,4	106,9	535,7
36-60	21,1	36,8	0,0	0,0	36,8	21,1	57,8
61-90	53,9	101,8	84,5	0,0	17,3	53,9	155,7
91-180	13,3	2,9	0,0	0,0	2,9	13,3	16,2
>180	3,0	0,4	0,0	0,0	0,4	3,0	3,4
Total	587,7	543,3	309,4	268,0	139,0	224,7	1036,0

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

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**	10	14	1451	1683	15	32	1592	1709	8	61	991	1036
Intragruppo y off-shore***	0	0	1177	470	0	0	1042	351	0	0	636	258
Otros	14	10	164	638	32	15	326	900	61	8	218	551
Total	24	24	2791	2791	47	47	2960	2960	69	69	1845	1845

* 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