

Fecha de Publicación: 14 de Enero de 2010
 Fecha de Información: 12 de Enero de 2010 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\$863,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	107,7	106,1	47,0	17,0	19,1	50,7	173,8
15-35	248,8	362,4	98,3	132,0	205,6	58,3	552,7
36-60	15,1	9,3	5,0	5,0	4,3	10,1	24,4
61-90	28,1	10,4	0,0	0,0	10,4	28,1	38,4
91-180	16,6	11,2	0,0	0,0	11,2	16,6	27,8
>180	0,0	46,8	38,0	0,0	8,8	0,0	46,8
Total	416,3	546,1	188,3	154,0	259,3	163,8	863,9

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

Sectores	11 al 15 de Enero				18 al 22 de Enero				25 al 29 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	36	1875	1834	10	66	1152	1174	5	169	681	849
Intragrupo y off-shore***	0	0	1089	487	0	0	712	299	0	0	453	66
Otros	36	19	366	1009	66	10	260	651	169	5	239	459
Total	55	55	3330	3330	76	76	2124	2124	174	174	1374	1374

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo