

Fecha de Publicación: 25 de Enero de 2010
Fecha de Información: 21 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\$1056,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	237,2	279,7	128,0	23,0	109,7	172,2	474,9
15-35	175,8	371,5	246,3	24,0	42,3	68,8	464,4
36-60	29,4	6,1	0,0	0,0	6,1	29,4	35,5
61-90	31,4	7,4	0,0	10,0	7,4	21,4	38,8
91-180	34,7	3,1	0,0	0,0	3,1	34,7	37,8
>180	4,4	0,8	0,0	0,0	0,8	4,4	5,1
Total	512,8	668,6	374,3	57,0	169,4	330,8	1056,5

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

*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	18 al 22 de Enero				25 al 29 de Enero				1 al 5 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	69	1290	1304	11	54	1216	1337	6	46	1349	1419
Intragruppo y off-shore***	0	1	793	324	0	0	579	109	0	0	739	418
Otros	69	13	309	764	54	11	466	815	46	6	360	611
Total	83	83	2392	2392	65	65	2261	2261	52	52	2447	2447

* 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