

Fecha de Publicación: 26 de Enero de 2010
Fecha de Información: 22 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\$670,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	195,5	97,0	3,0	45,0	71,0	127,5	269,5
15-35	173,5	196,5	105,5	35,5	45,0	92,0	323,9
36-60	6,1	2,7	0,0	4,8	2,7	1,2	8,7
61-90	2,5	0,7	0,0	0,0	0,7	2,5	3,2
91-180	7,8	10,1	0,0	0,0	10,1	7,8	17,9
>180	10,7	47,0	30,0	0,0	7,0	0,7	47,7
Total	396,0	353,9	138,5	85,3	136,4	231,6	670,9

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,5 %	1,9 %	1,4 %	1,6 %
15-35	1,2 %	2,2 %	1,7 %	1,9 %
36-60	-	2,8 %	1,8 %	2,1 %
61-90	-	3,1 %	1,7 %	2,0 %
91-180	-	3,2 %	2,7 %	3,0 %
>180	3,5 %	4,2 %	3,2 %	4,1 %
Total	1,6 %	2,4 %	1,6 %	1,9 %

*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	67	1290	1306	11	55	1337	1397	6	45	1424	1455
Intragruppo y off-shore***	0	1	793	324	0	0	579	139	0	0	742	433
Otros	67	13	312	764	55	11	520	900	45	6	375	654
Total	81	81	2395	2395	66	66	2436	2436	51	51	2541	2541

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo