

Fecha de Publicación: 12 de Febrero de 2010
Fecha de Información: 10 de Febrero 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\$1,059 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 03%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	178.5	131.2	31.5	52.0	59.6	86.5	269.6
15-35	430.2	297.5	135.0	171.0	60.5	157.2	625.7
36-60	0.1	61.4	50.0	0.0	11.4	0.1	61.5
61-90	16.7	20.7	0.0	0.0	9.9	6.0	26.6
91-180	7.3	18.4	0.0	0.0	18.4	7.3	25.7
>180	0.0	49.7	30.0	0.0	19.7	0.0	49.7
Total	632.8	578.8	246.5	223.0	179.5	257.0	1058.8

* 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	2.8 %	2.9 %	2.6 %	2.7 %
15-35	2.7 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	3.3 %	2.7 %	3.3 %
61-90	2.8 %	3.7 %	2.9 %	3.2 %
91-180	-	3.7 %	3.0 %	3.5 %
>180	-	4.0 %	-	4.0 %
Total	2.7 %	3.1 %	2.6 %	2.8 %

*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	8 al 12 de Febrero				15 al 19 de Febrero				22 al 26 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	75	2131	2304	36	83	1668	1829	3	73	2035	2424
Intragrupa y off-shore***	0	0	1175	840	7	0	886	317	0	0	1499	719
Otros	75	34	655	817	75	36	610	1018	73	3	461	851
Total	109	109	3962	3962	118	118	3164	3164	75	75	3995	3995

* 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 intragrupo