

Fecha de Publicación: 16 de Febrero de 2010
Fecha de Información: 12 de Febrero 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\$554 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.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	179.8	110.2	19.0	83.7	91.2	96.1	290.0
15-35	89.1	146.3	68.0	38.1	43.3	16.0	200.4
36-60	16.0	12.7	0.0	16.0	12.7	0.0	28.7
61-90	3.0	19.3	10.0	0.0	9.3	3.0	22.3
91-180	0.4	7.6	0.0	0.0	7.6	0.4	8.1
>180	0.0	4.3	0.0	0.0	4.3	0.0	4.3
Total	288.4	300.3	97.0	137.8	168.3	115.6	553.7

* 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	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.9 %	0.6 %	1.6 %	1.1 %
36-60	-	2.9 %	1.6 %	2.2 %
61-90	-	3.2 %	2.2 %	3.0 %
91-180	-	3.2 %	2.9 %	3.1 %
>180	-	4.2 %	-	4.2 %
Total	1.9 %	1.4 %	1.4 %	1.5 %

*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	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	73	2138	2307	35	85	1859	1984	2	78	2163	2481
Intragrupa y off-shore***	0	0	1175	846	7	1	893	402	0	0	1537	802
Otros	73	34	657	817	78	34	757	1124	78	2	479	897
Total	107	107	3970	3970	120	120	3510	3510	80	80	4179	4179

* 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