

Fecha de Publicación: 1 de Marzo de 2010
Fecha de Información: 25 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\$509 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	88.0	82.6	27.0	15.0	50.6	68.0	165.6
15-35	145.2	137.0	72.0	8.3	49.0	120.9	266.2
36-60	2.6	1.7	0.0	0.0	1.7	2.6	4.3
61-90	16.0	5.4	5.0	0.0	0.4	16.0	21.4
91-180	45.8	14.6	0.0	20.0	4.6	15.8	50.5
>180	0.0	0.8	0.0	0.0	0.8	0.0	0.8
Total	297.6	242.2	104.0	43.3	107.2	223.4	508.8

* 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	1.0 %	1.1 %	0.7 %	0.9 %
15-35	1.3 %	1.3 %	0.7 %	1.0 %
36-60	-	2.8 %	1.0 %	1.7 %
61-90	-	2.7 %	2.1 %	2.3 %
91-180	2.9 %	3.4 %	2.9 %	2.9 %
>180	-	4.2 %	2.8 %	4.2 %
Total	1.7 %	1.4 %	1.1 %	1.3 %

*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	22 al 26 de Febrero				1 al 5 de Marzo				8 al 12 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	156	2863	2849	7	33	1757	1639	5	26	1547	1355
Intragrupa y off-shore***	0	0	1599	999	0	0	847	584	0	0	793	525
Otros	156	8	770	1384	33	7	467	848	26	5	191	650
Total	164	164	5232	5232	40	40	3071	3071	31	31	2531	2531

* 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