

Fecha de Publicación: 16 de Abril de 2010
Fecha de Información: 14 de Abril 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\$798 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.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	133.7	115.4	25.0	88.7	75.4	30.0	234.1
15-35	232.7	268.0	63.0	87.3	133.5	74.0	429.2
36-60	12.4	5.6	5.0	0.0	0.6	12.4	18.0
61-90	51.0	18.7	0.0	0.0	13.7	46.0	64.8
91-180	44.3	12.3	0.0	0.0	2.3	34.3	46.6
>180	1.7	4.1	0.0	0.0	4.1	1.7	5.8
Total	475.8	424.1	93.0	176.0	229.6	198.3	798.4

* 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	0.0 %	1.1 %	0.1 %	0.5 %
15-35	0.4 %	1.0 %	0.5 %	0.7 %
36-60	-	1.6 %	0.7 %	1.0 %
61-90	1.4 %	2.0 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.8 %	2.6 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	3.7 %	2.9 %	3.5 %
Total	0.5 %	1.1 %	0.6 %	0.8 %

*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	12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	52	1792	1727	17	60	1285	1233	9	164	1530	1406
Intragruppo y off-shore***	0	1	971	569	0	0	744	237	0	0	797	172
Otros	52	20	388	855	60	17	270	829	164	9	271	1020
Total	73	73	3151	3151	77	77	2299	2299	174	174	2598	2598

* 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