

Fecha de Publicación: 18 de Marzo de 2010
Fecha de Información: 16 de Marzo 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\$629 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	79.0	73.5	48.1	15.0	25.4	63.9	152.4
15-35	206.5	193.2	127.8	43.0	45.2	143.2	379.4
36-60	28.1	5.7	0.0	0.0	5.7	28.1	33.8
61-90	9.7	6.0	0.0	0.0	6.0	9.7	15.7
91-180	23.2	1.0	0.0	0.0	1.0	23.2	24.2
>180	15.2	8.5	0.0	0.0	8.5	15.2	23.6
Total	361.7	287.9	175.8	58.0	91.7	283.3	629.2

* 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	2.0 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.5 %	2.1 %	1.1 %	1.5 %
36-60	-	2.6 %	1.8 %	2.0 %
61-90	-	3.4 %	2.2 %	2.6 %
91-180	-	3.4 %	2.4 %	2.4 %
>180	-	1.5 %	1.1 %	1.2 %
Total	1.5 %	1.9 %	1.3 %	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

Sector	15 al 19 de Marzo				22 al 26 de Marzo				29 de Mar. al 2 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	119	2892	3001	12	311	1002	792	4	67	1209	1297
Intragrupa y off-shore***	6	0	1660	951	0	0	362	69	0	0	824	439
Otros	114	13	740	1340	311	12	179	683	67	4	184	481
Total	132	132	5292	5292	324	324	1544	1544	71	71	2218	2218

* 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