

Fecha de Publicación: 21 de Enero de 2010
Fecha de Información: 19 de Enero 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\$922,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	57,1	58,8	24,6	12,0	34,2	45,1	115,9
15-35	276,0	289,5	176,0	42,0	66,5	187,0	518,5
36-60	126,2	139,7	0,0	11,0	54,7	30,2	180,9
61-90	7,0	9,0	0,0	0,0	9,0	7,0	16,1
91-180	38,9	5,9	0,0	0,0	5,9	38,9	44,9
>180	12,6	33,8	5,0	0,0	28,8	12,6	46,4
Total	517,9	536,8	205,6	65,0	199,2	320,9	922,6

* 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	-	1,6 %	0,6 %	1,1 %
15-35	0,7 %	1,4 %	0,9 %	1,1 %
36-60	1,1 %	1,6 %	1,2 %	1,3 %
61-90	-	2,5 %	1,2 %	1,9 %
91-180	-	3,1 %	1,5 %	1,7 %
>180	-	3,7 %	2,7 %	3,4 %
Total	1,0 %	1,7 %	1,0 %	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	18 al 22 de Enero				25 al 29 de Enero				1 al 5 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	67	1282	1277	9	176	968	1075	6	42	1185	1255
Intragrupo y off-shore***	0	1	766	316	0	0	487	99	0	0	692	380
Otros	67	13	309	764	176	9	335	617	42	6	300	543
Total	81	81	2357	2357	185	185	1791	1791	47	47	2177	2177

* 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