

Fecha de Publicación: 05 de Abril de 2010
Fecha de Información: 30 de Marzo 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\$795 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	68.1	18.1	5.0	18.8	13.1	49.4	86.2
15-35	197.6	424.0	320.5	13.0	43.5	124.6	561.6
36-60	62.1	27.2	0.0	0.0	27.2	62.1	89.2
61-90	6.4	10.8	7.0	0.0	3.8	6.4	17.2
91-180	28.8	0.8	0.0	0.0	0.8	28.8	29.6
>180	0.3	11.0	0.0	0.0	11.0	0.3	11.3
Total	363.3	491.9	332.5	31.8	99.4	271.5	795.2

* 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	-	2.3 %	0.9 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.5 %	0.5 %	1.2 %
36-60	-	1.9 %	0.4 %	0.9 %
61-90	-	2.8 %	1.0 %	2.1 %
91-180	-	3.5 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	3.8 %	2.9 %	3.8 %
Total	1.4 %	1.7 %	0.7 %	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

Sector	29 de Mar. al 2 de Abril				5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	144	1530	1598	16	235	1903	2162	9	43	1348	1280
Intragrupa y off-shore***	0	0	960	560	0	0	1198	609	0	0	728	351
Otros	144	6	264	596	235	16	527	857	43	9	292	737
Total	151	151	2753	2753	251	251	3627	3627	52	52	2369	2369

* 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