

Fecha de Publicación: 19 de Enero de 2010
Fecha de Información: 15 de Enero 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\$770,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	130,4	50,0	8,8	19,3	31,2	101,1	170,4
15-35	252,2	307,1	174,0	64,0	85,1	140,2	511,3
36-60	3,5	33,9	10,0	0,0	23,9	3,5	37,4
61-90	17,4	4,5	2,0	0,0	2,5	17,4	21,9
91-180	8,1	8,3	0,0	8,0	8,3	0,1	16,4
>180	5,4	7,9	0,0	0,0	7,9	5,4	13,3
Total	417,0	411,7	194,8	91,3	158,9	267,7	770,7

* 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 %	0,8 %	0,4 %	0,5 %
15-35	0,9 %	1,0 %	0,7 %	0,9 %
36-60	-	1,6 %	0,9 %	1,5 %
61-90	-	2,1 %	1,1 %	1,3 %
91-180	-	2,9 %	1,5 %	2,2 %
>180	-	3,6 %	3,2 %	3,4 %
Total	0,7 %	1,2 %	0,7 %	0,9 %

*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	11 al 15 de Enero				18 al 22 de Enero				25 al 29 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	37	1941	1833	13	73	1263	1261	6	176	920	1026
Intragruppo y off-shore***	0	0	1089	544	0	1	761	309	0	0	467	89
Otros	37	19	365	1019	73	12	299	752	176	6	306	579
Total	56	56	3395	3395	86	86	2322	2322	182	182	1693	1693

* 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