

Fecha de Publicación: 20 de Enero de 2010
Fecha de Información: 18 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\$115,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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	14,6	4,6	0,0	5,0	4,6	9,6	19,2
15-35	46,0	25,2	8,0	6,0	17,2	40,0	71,2
36-60	2,0	0,6	0,0	0,0	0,6	2,0	2,6
61-90	4,0	2,4	0,0	0,0	2,4	4,0	6,4
91-180	6,0	3,0	0,0	0,0	3,0	6,0	9,0
>180	0,0	7,0	0,0	0,0	7,0	0,0	7,0
Total	72,6	42,7	8,0	11,0	34,7	61,6	115,3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	0,9 %	0,5 %	0,6 %
15-35	-	1,2 %	1,1 %	1,1 %
36-60	-	2,0 %	0,8 %	1,0 %
61-90	-	2,1 %	1,3 %	1,6 %
91-180	-	3,2 %	1,1 %	1,8 %
>180	-	3,6 %	-	3,6 %
Total	-	1,8 %	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	71	1269	1267	6	176	935	1027	6	41	1154	1160
Intragruppo y off-shore***	0	1	761	309	0	0	467	94	0	0	620	380
Otros	71	13	304	758	176	6	307	588	41	6	292	527
Total	85	85	2333	2333	182	182	1709	1709	46	46	2066	2066

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo