

Fecha de Publicación: 11 de Febrero de 2010
Fecha de Información: 09 de Febrero 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\$1,020 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 03%.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	118.4	161.2	40.4	25.0	106.8	79.4	265.6
15-35	344.2	320.9	204.4	133.7	82.5	176.5	631.1
36-60	20.7	1.8	0.0	0.0	1.8	20.7	22.5
61-90	2.3	28.6	21.2	0.0	7.4	2.3	30.9
91-180	17.0	12.6	0.0	0.0	12.6	17.0	29.6
>180	30.0	10.6	0.0	0.0	10.6	30.0	40.6
Total	532.7	535.6	266.0	158.7	221.6	326.0	1020.3

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
15-35	3.2 %	3.1 %	2.2 %	2.7 %
36-60	-	3.5 %	2.6 %	2.7 %
61-90	-	3.6 %	2.5 %	3.5 %
91-180	-	3.5 %	2.9 %	3.2 %
>180	-	2.2 %	2.5 %	2.4 %
Total	3.6 %	3.0 %	2.3 %	2.7 %

*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	8 al 12 de Febrero				15 al 19 de Febrero				22 al 26 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	74	2131	2288	34	85	1555	1738	4	69	1951	2366
Intragrupa y off-shore***	0	0	1163	840	7	0	867	288	0	0	1477	688
Otros	74	33	650	817	77	34	558	954	69	4	444	819
Total	107	107	3945	3945	119	119	2979	2979	73	73	3873	3873

* 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