

Fecha de Publicación: 10 de Marzo de 2010
Fecha de Información: 08 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\$608 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	48.0	87.8	65.5	2.0	12.3	36.0	125.8
15-35	268.9	240.3	99.0	120.5	36.3	43.4	404.3
36-60	7.7	4.5	0.0	0.0	4.5	7.7	12.1
61-90	40.1	38.1	0.0	0.0	3.1	5.1	43.2
91-180	12.3	8.3	0.0	0.0	7.0	11.0	19.3
>180	0.0	3.6	0.0	0.0	3.6	0.0	3.6
Total	376.9	382.7	164.5	122.5	66.9	103.2	608.3

* 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	1.1 %	1.4 %	-0.1 %	0.9 %
15-35	0.9 %	0.8 %	0.8 %	0.8 %
36-60	-	2.4 %	1.5 %	1.8 %
61-90	1.6 %	2.8 %	2.1 %	1.8 %
91-180	2.9 %	3.7 %	1.5 %	2.4 %
>180	-	3.6 %	-	3.6 %
Total	1.1 %	1.2 %	0.7 %	1.0 %

*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 Marzo				15 al 19 de Marzo				22 al 26 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	31	1995	1829	12	108	2265	2373	11	291	750	631
Intragrupa y off-shore***	0	0	998	599	6	0	1342	699	0	0	309	37
Otros	31	10	372	937	102	12	581	1116	291	11	143	534
Total	41	41	3364	3364	120	120	4188	4188	303	303	1202	1202

* 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 intragrupo