

Fecha de Publicación: 31 de Marzo de 2010
Fecha de Información: 29 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\$807 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	183.2	40.3	5.0	89.2	35.3	94.0	223.5
15-35	217.7	246.8	185.8	86.5	40.0	110.2	443.5
36-60	35.8	4.0	0.0	0.6	4.0	35.2	39.8
61-90	7.1	8.6	8.0	0.0	0.6	7.1	15.6
91-180	44.4	36.6	30.0	0.0	6.6	44.4	81.0
>180	3.9	0.0	0.0	0.0	0.0	3.9	3.9
Total	492.0	336.3	228.8	176.3	86.5	294.7	807.2

* 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	-	2.1 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	2.5 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
>180	-	-	2.6 %	2.6 %
Total	1.8 %	2.1 %	1.5 %	1.7 %

*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

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	145	1525	1600	15	228	1846	2152	9	43	1326	1259
Intragrupa y off-shore***	0	0	960	555	0	0	1193	601	0	0	707	345
Otros	145	6	266	596	228	15	522	808	43	9	292	722
Total	151	151	2751	2751	243	243	3561	3561	51	51	2326	2326

* 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