

Fecha de Publicación: 05 de Abril de 2010
Fecha de Información: 31 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\$662 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.5%.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	103.1	45.5	35.0	56.0	10.5	47.1	148.6
15-35	134.5	288.4	197.5	3.0	79.9	120.5	411.9
36-60	12.3	1.2	0.0	0.0	1.2	12.3	13.5
61-90	14.7	29.4	0.0	0.0	29.4	14.7	44.1
91-180	0.4	29.2	20.0	0.0	9.2	0.4	29.7
>180	14.1	0.3	0.0	0.0	0.3	14.1	14.4
Total	279.1	394.0	252.5	59.0	130.5	209.1	662.1

* 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	-	0.8 %	-1.1 %	-0.9 %
15-35	0.4 %	1.1 %	-0.1 %	0.6 %
36-60	-	1.7 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	2.1 %	0.8 %	1.6 %
91-180	-	2.4 %	1.3 %	2.4 %
>180	-	3.3 %	2.1 %	2.1 %
Total	0.4 %	1.2 %	-0.3 %	0.5 %

*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	149	1530	1597	18	238	2002	2199	10	46	1350	1281
Intragruppo y off-shore***	0	0	960	560	0	0	1230	665	0	0	728	351
Otros	149	6	263	596	238	18	532	900	46	10	293	739
Total	155	155	2753	2753	256	256	3764	3764	56	56	2371	2371

* 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 intragruppo