

Fecha de Publicación: 07 de Abril de 2010
Fecha de Información: 05 de Abril 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\$523 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	76.3	79.3	35.0	42.0	37.3	27.3	148.5
15-35	134.6	160.9	79.0	45.0	63.9	71.6	277.5
36-60	36.3	19.4	0.0	0.0	19.4	36.3	55.8
61-90	10.4	0.8	0.0	0.0	0.8	10.4	11.2
91-180	18.5	1.0	0.0	0.4	1.0	18.1	19.5
>180	0.0	10.0	10.0	0.0	0.0	0.0	10.0
Total	276.2	271.3	124.0	87.4	122.3	163.8	522.5

* 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	0.0 %	0.2 %	0.0 %	0.1 %
15-35	0.8 %	1.0 %	-0.6 %	0.2 %
36-60	-	1.5 %	0.9 %	1.1 %
61-90	-	2.5 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	2.6 %	1.5 %	1.5 %
>180	-	3.4 %	-	3.4 %
Total	0.6 %	0.9 %	0.1 %	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

Sectores	5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	228	2059	2224	11	46	1368	1304	4	58	1037	984
Intragruppo y off-shore***	0	0	1255	705	0	0	737	355	0	0	673	170
Otros	228	18	532	917	46	11	300	746	58	4	192	749
Total	246	246	3846	3846	57	57	2405	2405	62	62	1902	1902

* 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