

Fecha de Publicación: 07 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 05 de Octubre de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1300,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 480,2 | 287,6 | 22,0 | 258,5 | 97,6 | 53,7 | 168,0 |
| 15-35 | 287,5 | 323,9 | 208,0 | 107,7 | 72,9 | 136,8 | 43,0 |
| 36-60 | 7,5 | 19,2 | 7,5 | 0,0 | 6,7 | 2,5 | 5,0 |
| 61-90 | 35,2 | 60,2 | 20,0 | 0,0 | 10,2 | 5,2 | 30,0 |
| 91-180 | 4,6 | 21,1 | 15,0 | 0,7 | 6,1 | 3,9 | 0,0 |
| >180 | 7,8 | 11,4 | 0,0 | 0,8 | 11,4 | 7,0 | 0,0 |
| Total | 822,9 | 723,2 | 272,5 | 367,6 | 204,7 | 209,2 | 246,0 |

* Cifras en millones de dólares

** Incluye operaciones interbancarias y operacines con los 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 | 2,7 % | 2,7 % | 1,4 % | 2,0 % |
| 15-35 | 1,9 % | 2,6 % | 1,8 % | 2,2 % |
| 36-60 | 2,5 % | 3,3 % | 1,9 % | 2,7 % |
| 61-90 | 2,4 % | 2,2 % | 1,9 % | 2,3 % |
| 91-180 | - | 2,4 % | 2,0 % | 2,3 % |
| >180 | - | 2,9 % | 2,0 % | 2,5 % |
| Total | 2,5 % | 2,6 % | 1,6 % | 2,1 % |

* 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 | 3 al 7 de Octubre | | | | 10 al 14 de Octubre | | | | 17 al 21 de Octubre | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 104 | 3751 | 3459 | 19 | 82 | 2144 | 2578 | 10 | 91 | 1957 | 2061 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1794 | 1368 | 0 | 1 | 1447 | 852 | 0 | 0 | 1273 | 644 |
| Otros | 104 | 22 | 708 | 1401 | 82 | 18 | 497 | 658 | 91 | 10 | 420 | 945 |
| Total | 126 | 126 | 6253 | 6228 | 101 | 101 | 4088 | 4087 | 101 | 101 | 3650 | 3650 |

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

** Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, 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.