

Fecha de Publicación: 8 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 06 de Octubre 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\$1136,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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 | 149,4 | 38,2 | 1,0 | 117,0 | 37,2 | 32,4 | 0,0 |
| 15-35 | 378,6 | 271,9 | 119,5 | 205,9 | 67,4 | 87,7 | 85,0 |
| 36-60 | 24,1 | 12,7 | 0,0 | 0,0 | 12,7 | 24,1 | 0,0 |
| 61-90 | 39,0 | 59,2 | 0,0 | 0,0 | 59,2 | 39,0 | 0,0 |
| 91-180 | 26,5 | 118,9 | 70,1 | 0,0 | 23,8 | 1,5 | 25,0 |
| >180 | 15,2 | 2,6 | 0,0 | 15,0 | 2,6 | 0,2 | 0,0 |
| Total | 632,8 | 503,4 | 190,6 | 337,9 | 202,8 | 184,9 | 110,0 |

* 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 | - | 0,2 % | -0,1 % | 0,0 % |
| 15-35 | 3,6 % | 0,0 % | -0,3 % | 0,4 % |
| 36-60 | - | 0,6 % | -0,2 % | 0,1 % |
| 61-90 | - | 0,3 % | 0,0 % | 0,1 % |
| 91-180 | 0,2 % | 0,7 % | 0,6 % | 0,4 % |
| >180 | - | 1,7 % | 1,3 % | 1,4 % |
| Total | 2,8 % | 0,2 % | -0,2 % | 0,3 % |

* 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 | 4 al 8 de Octubre | | | | 11 al 15 de Octubre | | | | 18 al 22 de Octubre | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 18 | 198 | 2136 | 1863 | 20 | 165 | 1961 | 1567 | 11 | 234 | 1169 | 1204 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1105 | 749 | 0 | 1 | 1014 | 875 | 0 | 0 | 834 | 338 |
| Otros | 198 | 18 | 313 | 942 | 165 | 19 | 226 | 759 | 234 | 11 | 169 | 629 |
| Total | 216 | 216 | 3554 | 3554 | 185 | 185 | 3200 | 3200 | 245 | 245 | 2172 | 2172 |

* 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 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