

Fecha de Publicación: 29 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 25 de Noviembre 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\$64,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|-------------|----------------------------|-------------|---------------|-------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2,7 | 1,0 | 0,0 | 0,0 | 1,0 | 2,7 | 0,0 |
| 15-35 | 22,1 | 4,7 | 0,0 | 11,0 | 1,7 | 8,1 | 3,0 |
| 36-60 | 3,9 | 7,8 | 0,0 | 0,0 | 7,8 | 3,9 | 0,0 |
| 61-90 | 5,8 | 3,6 | 0,0 | 0,0 | 3,6 | 5,8 | 0,0 |
| 91-180 | 10,6 | 1,1 | 0,0 | 0,0 | 1,1 | 10,6 | 0,0 |
| >180 | 1,3 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 1,3 | 0,0 |
| Total | 46,4 | 18,2 | 0,0 | 11,0 | 15,2 | 32,4 | 3,0 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------|---------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | - | 0,3 % | -4,8 % | -3,4 % |
| 15-35 | -3,5 % | -2,8 % | -3,6 % | -3,5 % |
| 36-60 | - | -2,0 % | -2,9 % | -2,3 % |
| 61-90 | - | -0,7 % | -1,8 % | -1,4 % |
| 91-180 | - | 1,1 % | -0,9 % | -0,7 % |
| >180 | - | - | 0,2 % | 0,2 % |
| Total | -3,5 % | -1,4 % | -2,6 % | -2,3 % |

*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 | 22 al 26 de Noviembre | | | | 29 de Nov. al 3 de Diciembre | | | | 6 al 10 de Diciembre | | | |
|----------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 28 | 186 | 2516 | 2042 | 21 | 317 | 2093 | 2071 | 9 | 260 | 1438 | 1023 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 1 | 1170 | 1035 | 0 | 0 | 1313 | 647 | 0 | 0 | 601 | 608 |
| Otros | 186 | 27 | 431 | 1040 | 317 | 21 | 395 | 1083 | 260 | 9 | 203 | 612 |
| Total | 214 | 214 | 4117 | 4117 | 338 | 338 | 3800 | 3800 | 269 | 269 | 2242 | 2242 |

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo