

Fecha de Publicación: 04 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 02 de Noviembre de 2011 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\$1201,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,7%.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 | 209,7 | 46,5 | 10,0 | 156,0 | 9,1 | 26,3 | 27,4 |
| 15-35 | 415,5 | 328,9 | 201,3 | 286,5 | 38,3 | 39,7 | 89,3 |
| 36-60 | 19,6 | 42,4 | 28,0 | 10,0 | 14,4 | 9,6 | 0,0 |
| 61-90 | 55,2 | 34,6 | 0,0 | 0,0 | 14,6 | 35,2 | 20,0 |
| 91-180 | 97,0 | 25,9 | 23,0 | 5,0 | 2,9 | 92,0 | 0,0 |
| >180 | 20,8 | 41,5 | 40,0 | 20,0 | 1,5 | 0,8 | 0,0 |
| Total | 817,9 | 519,9 | 302,3 | 477,5 | 81,0 | 203,7 | 136,7 |

* 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 | -33,6 % | 0,7 % | -0,4 % | -5,4 % |
| 15-35 | 0,5 % | 0,3 % | 0,1 % | 0,2 % |
| 36-60 | - | 1,0 % | 0,6 % | 0,8 % |
| 61-90 | 0,1 % | 1,3 % | 0,1 % | 0,3 % |
| 91-180 | - | 0,6 % | -0,7 % | -0,4 % |
| >180 | - | 0,9 % | 0,8 % | 0,9 % |
| Total | -6,4 % | 0,5 % | -0,1 % | -0,7 % |

* 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 | 31 de Oct. al 4 de Noviembre | | | | 7 al 11 de Noviembre | | | | 14 al 18 de Noviembre | | | |
|---------------------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 14 | 95 | 3100 | 2306 | 18 | 125 | 2116 | 1779 | 15 | 172 | 2267 | 2162 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1476 | 1569 | 0 | 1 | 1105 | 1031 | 0 | 0 | 1364 | 881 |
| Otros | 95 | 14 | 388 | 1088 | 125 | 17 | 289 | 701 | 172 | 15 | 309 | 897 |
| Total | 109 | 109 | 4964 | 4964 | 144 | 144 | 3511 | 3511 | 187 | 187 | 3940 | 3940 |

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