

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 16 de Agosto 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\$1280,0 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 | 203,2 | 150,0 | 98,3 | 100,2 | 11,7 | 63,0 | 40,0 |
| 15-35 | 375,5 | 517,2 | 271,5 | 118,0 | 42,7 | 54,5 | 203,0 |
| 36-60 | 105,3 | 112,7 | 0,0 | 0,0 | 7,7 | 0,3 | 105,0 |
| 61-90 | 0,9 | 8,1 | 0,0 | 0,0 | 8,1 | 0,9 | 0,0 |
| 91-180 | 60,2 | 74,2 | 0,0 | 0,0 | 34,2 | 20,2 | 40,0 |
| >180 | 18,8 | 41,8 | 0,0 | 0,0 | 41,8 | 18,8 | 0,0 |
| Total | 764,0 | 904,0 | 369,8 | 218,2 | 146,2 | 157,8 | 388,0 |

* 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 | 3,1 % | 2,5 % | 0,5 % | 1,5 % |
| 15-35 | 2,3 % | 2,5 % | 2,4 % | 2,4 % |
| 36-60 | 2,6 % | 3,3 % | 2,2 % | 2,7 % |
| 61-90 | - | 3,1 % | 1,9 % | 2,9 % |
| 91-180 | 1,3 % | 2,6 % | 2,1 % | 1,9 % |
| >180 | - | 1,9 % | 1,7 % | 1,8 % |
| Total | 2,4 % | 2,5 % | 1,5 % | 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 | 15 al 19 de Agosto | | | | 22 al 26 de Agosto | | | | 29 de Ago. al 2 de Septiembre | | | |
|---------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|-------------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 17 | 85 | 1951 | 2425 | 18 | 134 | 1772 | 1755 | 9 | 189 | 1935 | 2061 |
| Intragrupa y off-shore*** | 8 | 0 | 1381 | 705 | 0 | 0 | 876 | 525 | 0 | 0 | 1164 | 784 |
| Otros | 77 | 17 | 680 | 883 | 134 | 18 | 450 | 818 | 189 | 9 | 499 | 753 |
| Total | 101 | 101 | 4013 | 4013 | 152 | 152 | 3098 | 3098 | 197 | 197 | 3598 | 3598 |

* 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.