

Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 13 de Septiembre 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\$1022,4 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 | 219,1 | 187,0 | 10,0 | 68,0 | 45,0 | 19,1 | 132,0 |
| 15-35 | 421,3 | 228,8 | 91,5 | 254,5 | 30,3 | 59,8 | 107,0 |
| 36-60 | 28,8 | 24,8 | 20,0 | 15,0 | 4,8 | 13,8 | 0,0 |
| 61-90 | 3,4 | 3,5 | 0,0 | 0,0 | 3,5 | 3,4 | 0,0 |
| 91-180 | 29,8 | 3,2 | 0,0 | 20,6 | 3,2 | 9,2 | 0,0 |
| >180 | 25,4 | 86,2 | 80,5 | 0,0 | 5,7 | 25,4 | 0,0 |
| Total | 727,8 | 533,6 | 202,0 | 358,1 | 92,6 | 130,7 | 239,0 |

* 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 | 2,1 % | 4,5 % | -11,2 % | 1,5 % |
| 15-35 | 2,8 % | 2,4 % | 2,1 % | 2,4 % |
| 36-60 | - | 2,9 % | 2,8 % | 2,8 % |
| 61-90 | - | 3,0 % | 2,1 % | 2,5 % |
| 91-180 | - | 2,8 % | 2,3 % | 2,3 % |
| >180 | - | 2,0 % | 1,7 % | 1,9 % |
| Total | 2,4 % | 2,9 % | 1,3 % | 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 | 12 al 16 de Septiembre | | | | 19 al 23 de Septiembre | | | | 26 al 30 de Septiembre | | | |
|---------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 45 | 88 | 2955 | 2840 | 18 | 98 | 2302 | 2435 | 13 | 385 | 2139 | 1614 |
| Intragrupa y off-shore*** | 5 | 1 | 1496 | 940 | 0 | 0 | 1384 | 800 | 0 | 0 | 673 | 861 |
| Otros | 82 | 44 | 703 | 1374 | 98 | 18 | 422 | 873 | 385 | 13 | 472 | 810 |
| Total | 133 | 133 | 5154 | 5154 | 116 | 116 | 4108 | 4108 | 398 | 398 | 3285 | 3285 |

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.