

Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 23 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\$1262,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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 | 208,0 | 219,8 | 85,0 | 132,5 | 110,8 | 51,5 | 24,0 |
| 15-35 | 376,1 | 303,5 | 164,0 | 233,0 | 22,5 | 26,1 | 117,0 |
| 36-60 | 35,1 | 3,2 | 0,0 | 6,5 | 3,2 | 28,6 | 0,0 |
| 61-90 | 43,5 | 102,0 | 90,0 | 5,0 | 2,0 | 28,5 | 10,0 |
| 91-180 | 17,8 | 31,9 | 0,0 | 0,0 | 26,9 | 12,8 | 5,0 |
| >180 | 24,9 | 62,5 | 45,0 | 0,0 | 7,5 | 14,9 | 10,0 |
| Total | 705,3 | 722,9 | 384,0 | 377,0 | 172,9 | 162,3 | 166,0 |

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

* 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 | 19 al 23 de Septiembre | | | | 26 al 30 de Septiembre | | | | 3 al 7 de Octubre | | | |
|---------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 17 | 83 | 3020 | 2948 | 17 | 386 | 2734 | 2554 | 12 | 113 | 2134 | 2246 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1610 | 1361 | 0 | 0 | 1118 | 1030 | 0 | 0 | 1355 | 340 |
| Otros | 83 | 17 | 588 | 909 | 386 | 17 | 792 | 1060 | 113 | 12 | 263 | 1140 |
| Total | 100 | 100 | 5218 | 5218 | 403 | 403 | 4644 | 4644 | 125 | 125 | 3752 | 3727 |

* 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.