

Fecha de Publicación: 05 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 03 de Mayo 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\$1209,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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 | 139,1 | 165,1 | 136,0 | 60,4 | 6,1 | 55,7 | 23,0 |
| 15-35 | 282,2 | 317,1 | 109,0 | 124,5 | 116,1 | 65,7 | 92,0 |
| 36-60 | 44,3 | 56,0 | 15,0 | 0,0 | 11,0 | 14,3 | 30,0 |
| 61-90 | 31,5 | 62,3 | 0,0 | 0,0 | 62,3 | 31,5 | 0,0 |
| 91-180 | 14,4 | 36,0 | 0,0 | 0,0 | 36,0 | 14,4 | 0,0 |
| >180 | 48,2 | 13,1 | 0,0 | 25,0 | 3,1 | 13,2 | 10,0 |
| Total | 559,7 | 649,6 | 260,0 | 209,9 | 234,6 | 194,8 | 155,0 |

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

* 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 | 2 al 6 de Mayo | | | | 9 al 13 de Mayo | | | | 16 al 20 de Mayo | | | |
|---------------------------|----------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 6 | 226 | 2236 | 2089 | 40 | 213 | 1853 | 1903 | 6 | 138 | 1134 | 1069 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 992 | 988 | 2 | 0 | 741 | 654 | 0 | 0 | 554 | 400 |
| Otros | 226 | 6 | 494 | 645 | 211 | 40 | 756 | 793 | 138 | 6 | 319 | 537 |
| Total | 231 | 231 | 3722 | 3722 | 253 | 253 | 3349 | 3349 | 144 | 144 | 2006 | 2006 |

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