

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2011
Fecha de Información: 15 de Junio de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1244,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 219,7 | 134,9 | 88,0 | 64,0 | 15,4 | 124,2 | 31,5 |
| 15-35 | 270,9 | 438,0 | 299,0 | 87,7 | 34,5 | 78,7 | 104,5 |
| 36-60 | 24,1 | 2,9 | 0,0 | 0,0 | 2,9 | 24,1 | 0,0 |
| 61-90 | 28,3 | 3,5 | 0,0 | 0,0 | 3,5 | 28,3 | 0,0 |
| 91-180 | 28,2 | 61,1 | 0,0 | 5,0 | 61,1 | 23,2 | 0,0 |
| >180 | 23,9 | 9,3 | 0,0 | 20,0 | 9,3 | 3,9 | 0,0 |
| Total | 595,1 | 649,6 | 387,0 | 176,7 | 126,6 | 282,4 | 136,0 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 0,5 % | 0,9 % | 0,2 % | 0,4 % |
| 15-35 | 0,8 % | 1,1 % | 0,7 % | 0,9 % |
| 36-60 | - | 2,2 % | 0,5 % | 0,7 % |
| 61-90 | - | 1,9 % | 0,7 % | 0,8 % |
| 91-180 | - | 1,1 % | 0,7 % | 1,0 % |
| >180 | - | 1,8 % | 1,3 % | 1,4 % |
| Total | 0,8 % | 1,1 % | 0,5 % | 0,8 % |

* 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 | 13 al 17 de Junio | | | | 20 al 24 de Junio | | | | 27 de Jun. al 1 de Julio | | | |
|----------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 16 | 130 | 2985 | 3275 | 15 | 185 | 2562 | 2372 | 6 | 414 | 1866 | 1911 |
| Intragruppo y off-shore*** | 3 | 0 | 1910 | 1436 | 0 | 1 | 1197 | 1011 | 0 | 0 | 990 | 898 |
| Otros | 127 | 16 | 831 | 1016 | 185 | 13 | 501 | 877 | 414 | 6 | 608 | 655 |
| Total | 146 | 146 | 5727 | 5727 | 200 | 200 | 4260 | 4260 | 420 | 420 | 3464 | 3464 |

* 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 intragruppo