

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2011
Fecha de Información: 08 de Julio 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\$1223,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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 | 47,0 | 190,9 | 105,9 | 25,0 | 80,0 | 17,0 | 5,0 |
| 15-35 | 227,0 | 376,6 | 194,5 | 109,0 | 81,1 | 17,0 | 101,0 |
| 36-60 | 0,9 | 6,3 | 0,0 | 0,0 | 6,3 | 0,9 | 0,0 |
| 61-90 | 101,1 | 50,1 | 10,0 | 5,0 | 30,1 | 86,1 | 10,0 |
| 91-180 | 20,9 | 74,6 | 10,0 | 0,0 | 44,6 | 0,9 | 20,0 |
| >180 | 100,0 | 28,1 | 0,0 | 90,0 | 18,1 | 0,0 | 10,0 |
| Total | 496,9 | 726,6 | 320,4 | 229,0 | 260,2 | 121,9 | 146,0 |

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

* 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 | 4 al 8 de Julio | | | | 11 al 15 de Julio | | | | 18 al 22 de Julio | | | |
|---------------------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 9 | 99 | 2148 | 2212 | 7 | 165 | 2198 | 2770 | 4 | 65 | 1858 | 2117 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1176 | 798 | 0 | 0 | 1685 | 859 | 0 | 0 | 1411 | 811 |
| Otros | 99 | 9 | 546 | 861 | 165 | 7 | 730 | 983 | 64 | 4 | 398 | 740 |
| Total | 108 | 108 | 3870 | 3870 | 172 | 172 | 4613 | 4613 | 68 | 68 | 3667 | 3667 |

* 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