

Fecha de Publicación: 22 de Julio de 2011
 Fecha de Información: 19 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\$868,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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 | 185,5 | 69,7 | 47,0 | 47,0 | 2,7 | 118,5 | 20,0 |
| 15-35 | 195,2 | 264,9 | 136,0 | 68,0 | 72,9 | 71,2 | 56,0 |
| 36-60 | 71,6 | 3,7 | 0,0 | 0,0 | 3,7 | 71,6 | 0,0 |
| 61-90 | 34,6 | 2,7 | 0,0 | 0,4 | 2,7 | 34,3 | 0,0 |
| 91-180 | 0,1 | 25,3 | 0,0 | 0,0 | 25,3 | 0,1 | 0,0 |
| >180 | 10,0 | 4,7 | 0,0 | 10,0 | 4,7 | 0,0 | 0,0 |
| Total | 497,1 | 371,0 | 183,0 | 125,4 | 112,0 | 295,7 | 76,0 |

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

*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

| Sectores | 18 al 22 de Julio | | | | 25 al 29 de Julio | | | | 1 al 5 de Agosto | | | |
|----------------------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 11 | 67 | 2279 | 2432 | 7 | 198 | 2093 | 2076 | 4 | 199 | 1552 | 1929 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 1 | 1553 | 994 | 0 | 0 | 922 | 753 | 0 | 0 | 1283 | 601 |
| Otros | 67 | 9 | 432 | 838 | 198 | 7 | 619 | 805 | 199 | 4 | 305 | 611 |
| Total | 78 | 78 | 4265 | 4265 | 206 | 206 | 3634 | 3634 | 203 | 203 | 3141 | 3141 |

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