

Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 28 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\$843,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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 | 99,9 | 132,1 | 49,0 | 35,0 | 43,1 | 24,9 | 40,0 |
| 15-35 | 192,5 | 191,7 | 121,7 | 90,6 | 34,0 | 65,9 | 36,0 |
| 36-60 | 1,8 | 0,3 | 0,0 | 0,0 | 0,3 | 1,8 | 0,0 |
| 61-90 | 74,2 | 5,9 | 0,0 | 0,0 | 5,9 | 74,2 | 0,0 |
| 91-180 | 35,3 | 28,8 | 5,0 | 5,0 | 23,8 | 30,3 | 0,0 |
| >180 | 20,9 | 59,8 | 37,5 | 0,0 | 17,3 | 15,9 | 5,0 |
| Total | 424,7 | 418,5 | 213,2 | 130,6 | 124,3 | 213,1 | 81,0 |

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

* 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 | 25 al 29 de Julio | | | | 1 al 5 de Agosto | | | | 8 al 12 de Agosto | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 74 | 159 | 2455 | 2608 | 7 | 203 | 1813 | 2212 | 7 | 144 | 2215 | 2149 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1260 | 889 | 0 | 0 | 1367 | 736 | 0 | 0 | 946 | 829 |
| Otros | 158 | 74 | 726 | 944 | 203 | 7 | 452 | 683 | 144 | 7 | 559 | 742 |
| Total | 233 | 233 | 4441 | 4441 | 209 | 209 | 3632 | 3632 | 152 | 152 | 3720 | 3720 |

* 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