

Fecha de Publicación: 30 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 28 de Mayo de 2012 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\$229,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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 | 35,9 | 31,2 | 16,1 | 16,1 | 15,1 | 19,8 | 0,0 |
| 15-35 | 67,3 | 41,4 | 16,0 | 36,0 | 15,4 | 21,3 | 10,0 |
| 36-60 | 3,1 | 3,4 | 0,0 | 0,0 | 3,4 | 3,1 | 0,0 |
| 61-90 | 0,1 | 5,3 | 0,0 | 0,0 | 5,3 | 0,1 | 0,0 |
| 91-180 | 21,3 | 5,9 | 0,0 | 0,0 | 5,9 | 21,3 | 0,0 |
| >180 | 12,1 | 22,6 | 10,5 | 0,0 | 2,1 | 2,1 | 10,0 |
| Total | 139,8 | 109,7 | 42,6 | 52,1 | 47,1 | 67,7 | 20,0 |

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

*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 | 28 de May. al 1 de Junio | | | | 4 al 8 de Junio | | | | 11 al 15 de Junio | | | |
|----------------------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 11 | 115 | 2560 | 2277 | 22 | 130 | 2600 | 3070 | 246 | 90 | 2466 | 3357 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1332 | 826 | 0 | 0 | 1718 | 689 | 0 | 0 | 2371 | 619 |
| Otros | 114 | 11 | 347 | 1136 | 130 | 22 | 536 | 1095 | 90 | 246 | 250 | 1110 |
| Total | 126 | 126 | 4240 | 4240 | 151 | 151 | 4854 | 4854 | 336 | 336 | 5087 | 5087 |

* 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 El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.