

Fecha de Publicación: 08 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 06 de Junio 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\$1671,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 372,1 | 217,7 | 23,0 | 296,6 | 159,3 | 40,1 | 35,4 |
| 15-35 | 467,2 | 538,6 | 433,5 | 289,4 | 25,1 | 97,8 | 80,0 |
| 36-60 | 100,2 | 48,3 | 10,1 | 3,0 | 18,2 | 77,2 | 20,0 |
| 61-90 | 1,3 | 12,4 | 0,0 | 0,0 | 12,4 | 1,3 | 0,0 |
| 91-180 | 10,2 | 21,5 | 0,0 | 0,0 | 11,5 | 0,2 | 10,0 |
| >180 | 15,7 | 11,6 | 0,0 | 15,0 | 11,6 | 0,7 | 0,0 |
| Total | 966,6 | 850,0 | 466,6 | 604,0 | 238,0 | 217,2 | 145,4 |

* 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 | 6,9 % | 5,6 % | 4,1 % | 4,8 % |
| 15-35 | 4,8 % | 5,4 % | 4,8 % | 5,1 % |
| 36-60 | 5,4 % | 5,7 % | 5,3 % | 5,4 % |
| 61-90 | - | 5,6 % | 3,3 % | 5,4 % |
| 91-180 | 4,9 % | 4,1 % | 4,2 % | 4,4 % |
| >180 | - | 4,2 % | 4,0 % | 4,0 % |
| Total | 5,4 % | 5,4 % | 4,5 % | 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 | 4 al 8 de Junio | | | | 11 al 15 de Junio | | | | 18 al 22 de Junio | | | |
|---------------------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 34 | 110 | 3515 | 3729 | 254 | 92 | 3348 | 4169 | 74 | 68 | 1980 | 2613 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2096 | 1320 | 0 | 1 | 2699 | 1054 | 0 | 0 | 2043 | 714 |
| Otros | 110 | 34 | 734 | 1296 | 92 | 252 | 485 | 1309 | 67 | 74 | 255 | 951 |
| Total | 144 | 144 | 6345 | 6345 | 346 | 346 | 6532 | 6532 | 142 | 142 | 4278 | 4278 |

* 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.