

Fecha de Publicación: 5 de abril de 2013

Fecha de Información: 03 de abril de 2013 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\$1712,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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 | 326,3 | 108,0 | 45,0 | 217,5 | 25,8 | 71,6 | 37,2 |
| 15-35 | 444,4 | 525,1 | 399,5 | 224,0 | 71,1 | 165,9 | 54,5 |
| 36-60 | 62,4 | 167,6 | 99,0 | 0,0 | 68,6 | 62,4 | 0,0 |
| 61-90 | 91,5 | 56,7 | 30,0 | 0,0 | 11,7 | 76,5 | 15,0 |
| 91-180 | 1,2 | 19,0 | 0,0 | 0,0 | 19,0 | 1,2 | 0,0 |
| >180 | 14,8 | 2,1 | 0,0 | 10,0 | 2,1 | 4,8 | 0,0 |
| Total | 940,5 | 878,6 | 573,5 | 451,5 | 198,4 | 382,4 | 106,7 |

* Cifras en millones de dólares

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

* 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 | 1 al 5 de abril | | | | 8 al 12 de abril | | | | 15 al 19 de abril | | | |
|----------------------------------|-----------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 13 | 96 | 3905 | 3220 | 27 | 140 | 2401 | 2473 | 12 | 113 | 1897 | 2685 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1810 | 1060 | 0 | 1 | 1540 | 696 | 0 | 0 | 1938 | 784 |
| Otros | 96 | 13 | 654 | 2089 | 140 | 26 | 623 | 1395 | 113 | 12 | 398 | 764 |
| Total | 110 | 110 | 6369 | 6369 | 167 | 167 | 4564 | 4564 | 125 | 125 | 4233 | 4233 |

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.