

Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2013

Fecha de Información: 17 de mayo 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\$847,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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 | 152,2 | 203,4 | 51,5 | 60,5 | 78,9 | 18,7 | 73,1 |
| 15-35 | 223,8 | 334,1 | 198,0 | 74,0 | 13,9 | 27,5 | 122,3 |
| 36-60 | 6,5 | 3,2 | 0,0 | 0,0 | 3,2 | 6,5 | 0,0 |
| 61-90 | 8,7 | 1,7 | 0,0 | 0,0 | 1,7 | 8,7 | 0,0 |
| 91-180 | 1,0 | 10,9 | 0,0 | 0,0 | 10,9 | 1,0 | 0,0 |
| >180 | 22,9 | 79,0 | 70,8 | 10,0 | 3,2 | 7,9 | 5,0 |
| Total | 415,1 | 632,4 | 320,3 | 144,5 | 111,8 | 70,3 | 200,3 |

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

*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 | 13 al 17 de mayo | | | | 20 al 24 de mayo | | | | 27 al 31 de mayo | | | |
|---------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 23 | 86 | 3247 | 3458 | 16 | 124 | 4383 | 4118 | 9 | 70 | 1628 | 1917 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2005 | 1141 | 0 | 0 | 2360 | 1769 | 0 | 0 | 1289 | 535 |
| Otros | 86 | 23 | 704 | 1358 | 124 | 16 | 826 | 1681 | 70 | 9 | 351 | 817 |
| Total | 109 | 109 | 5957 | 5957 | 139 | 139 | 7568 | 7568 | 79 | 79 | 3269 | 3269 |

* 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.