

Fecha de Publicación: 4 de julio de 2013

Fecha de Información: 02 de julio 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\$1556,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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 | 529,1 | 192,1 | 71,0 | 247,0 | 11,1 | 172,1 | 110,0 |
| 15-35 | 172,6 | 631,0 | 546,0 | 81,2 | 22,0 | 28,4 | 63,0 |
| 36-60 | 17,9 | 35,7 | 0,0 | 0,0 | 35,7 | 17,9 | 0,0 |
| 61-90 | 40,8 | 53,3 | 0,0 | 35,8 | 50,3 | 2,0 | 3,0 |
| 91-180 | 15,2 | 38,5 | 18,0 | 0,0 | 5,5 | 0,2 | 15,0 |
| >180 | 0,3 | 21,1 | 20,0 | 0,0 | 1,1 | 0,3 | 0,0 |
| Total | 776,0 | 971,7 | 655,0 | 364,0 | 125,7 | 220,9 | 191,0 |

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

*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 | 1 al 5 de julio | | | | 8 al 12 de julio | | | | 15 al 19 de julio | | | |
|---------------------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 10 | 44 | 2786 | 3056 | 102 | 56 | 2672 | 2733 | 107 | 137 | 2299 | 2594 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 1 | 1864 | 1064 | 0 | 0 | 1785 | 664 | 0 | 0 | 1627 | 891 |
| Otros | 44 | 9 | 388 | 917 | 56 | 102 | 371 | 1430 | 137 | 107 | 454 | 895 |
| Total | 54 | 54 | 5037 | 5037 | 158 | 158 | 4828 | 4828 | 245 | 245 | 4381 | 4381 |

* 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.