

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1275,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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 | 304,1 | 281,3 | 212,0 | 108,5 | 9,3 | 135,6 | 60,0 |
| 15-35 | 255,6 | 348,6 | 285,0 | 40,5 | 49,6 | 201,1 | 14,0 |
| 36-60 | 16,3 | 8,6 | 0,0 | 0,0 | 8,6 | 16,3 | 0,0 |
| 61-90 | 46,1 | 36,6 | 2,1 | 0,5 | 14,5 | 25,6 | 20,0 |
| 91-180 | 8,4 | 25,9 | 0,0 | 0,0 | 25,9 | 8,4 | 0,0 |
| >180 | 12,0 | 26,2 | 1,0 | 0,0 | 25,2 | 12,0 | 0,0 |
| Total | 642,6 | 727,3 | 500,2 | 149,5 | 133,1 | 399,1 | 94,0 |

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

*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 | 8 al 12 de julio | | | | 15 al 19 de julio | | | | 22 al 26 de julio | | | |
|----------------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 114 | 62 | 3636 | 3316 | 111 | 146 | 2942 | 3132 | 16 | 96 | 2177 | 2612 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2092 | 1194 | 0 | 0 | 1909 | 927 | 0 | 0 | 1659 | 897 |
| Otros | 62 | 114 | 397 | 1615 | 146 | 111 | 496 | 1289 | 96 | 16 | 403 | 730 |
| Total | 175 | 175 | 6125 | 6125 | 258 | 258 | 5348 | 5348 | 112 | 112 | 4239 | 4239 |

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.