

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2013

Fecha de Información: 17 de julio de 2013 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1420,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

| Rango        | Sector Financiero** |              | Intragrupa y Off-shore*** |              | Otros Agentes |              | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas       | Compras                   | Ventas       | Compras       | Ventas       |                |
| 3-14         | 473,7               | 158,4        | 111,0                     | 325,5        | 12,4          | 113,2        | 35,0           |
| 15-35        | 324,0               | 431,8        | 322,8                     | 128,0        | 74,0          | 161,0        | 35,0           |
| 36-60        | 16,6                | 31,6         | 0,0                       | 0,0          | 15,6          | 0,6          | 16,0           |
| 61-90        | 2,1                 | 35,2         | 0,0                       | 0,0          | 35,2          | 2,1          | 0,0            |
| 91-180       | 1,5                 | 16,7         | 2,2                       | 0,0          | 14,1          | 1,1          | 0,4            |
| >180         | 11,2                | 9,6          | 0,0                       | 0,0          | 4,6           | 6,2          | 5,0            |
| <b>Total</b> | <b>829,0</b>        | <b>683,2</b> | <b>436,0</b>              | <b>453,5</b> | <b>155,8</b>  | <b>284,1</b> | <b>91,4</b>    |

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

\* 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                  | 15 al 19 de julio |            |             |             | 22 al 26 de julio |            |             |             | 29 de jul. al 2 de agosto |           |             |             |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------------|-----------|-------------|-------------|
|                           | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery                  |           | NDF         |             |
|                           | C                 | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           | C                         | V         | C           | V           |
| Sector Financiero**       | 102               | 133        | 3669        | 3393        | 18                | 110        | 2859        | 3100        | 5                         | 62        | 1623        | 2191        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                 | 0          | 2022        | 1487        | 0                 | 0          | 1903        | 1085        | 0                         | 0         | 1322        | 494         |
| Otros                     | 133               | 102        | 539         | 1351        | 110               | 18         | 452         | 1028        | 62                        | 5         | 314         | 574         |
| <b>Total</b>              | <b>235</b>        | <b>235</b> | <b>6231</b> | <b>6231</b> | <b>128</b>        | <b>128</b> | <b>5214</b> | <b>5214</b> | <b>67</b>                 | <b>67</b> | <b>3259</b> | <b>3259</b> |

\* 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.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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.