

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1240,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 520,7 | 281,8 | 151,0 | 89,5 | 4,8 | 305,2 | 126,0 |
| 15-35 | 285,4 | 215,1 | 198,0 | 67,5 | 9,1 | 209,9 | 8,0 |
| 36-60 | 3,8 | 8,5 | 0,0 | 0,0 | 8,5 | 3,8 | 0,0 |
| 61-90 | 3,1 | 7,4 | 0,0 | 0,0 | 7,4 | 3,1 | 0,0 |
| 91-180 | 30,5 | 15,3 | 5,0 | 0,0 | 10,3 | 30,5 | 0,0 |
| >180 | 1,0 | 1,7 | 0,0 | 0,0 | 1,7 | 1,0 | 0,0 |
| Total | 844,5 | 529,8 | 354,0 | 157,0 | 41,8 | 553,5 | 134,0 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 4,6 % | 2,7 % | 3,7 % | 3,7 % |
| 15-35 | 4,8 % | 4,6 % | 4,3 % | 4,4 % |
| 36-60 | - | 4,6 % | 3,7 % | 4,3 % |
| 61-90 | - | 4,5 % | 3,8 % | 4,3 % |
| 91-180 | - | 4,5 % | 4,0 % | 4,1 % |
| >180 | - | 5,3 % | 3,6 % | 4,6 % |
| Total | 4,7 % | 3,8 % | 3,9 % | 4,0 % |

*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 | 22 al 26 de julio | | | | 29 de jul. al 2 de agosto | | | | 5 al 9 de agosto | | | |
|----------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 20 | 114 | 3312 | 3499 | 8 | 65 | 2521 | 2808 | 11 | 72 | 2173 | 2699 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2114 | 1227 | 0 | 0 | 1488 | 620 | 0 | 0 | 1457 | 632 |
| Otros | 114 | 20 | 455 | 1154 | 65 | 8 | 352 | 932 | 72 | 11 | 464 | 763 |
| Total | 134 | 134 | 5881 | 5881 | 73 | 73 | 4361 | 4361 | 83 | 83 | 4094 | 4094 |

* 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 intragruppo.