

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2013

Fecha de Información: 02 de agosto 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\$1530,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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 | 388,3 | 327,6 | 229,0 | 189,0 | 8,6 | 109,3 | 90,0 |
| 15-35 | 513,5 | 513,9 | 153,0 | 78,0 | 130,9 | 205,5 | 230,0 |
| 36-60 | 3,7 | 9,2 | 0,0 | 0,0 | 9,2 | 3,7 | 0,0 |
| 61-90 | 24,0 | 26,4 | 0,8 | 0,0 | 10,6 | 9,0 | 15,0 |
| 91-180 | 15,6 | 51,3 | 1,8 | 0,0 | 39,6 | 5,6 | 10,0 |
| >180 | 0,7 | 1,6 | 0,0 | 0,0 | 1,6 | 0,7 | 0,0 |
| Total | 945,8 | 930,0 | 384,5 | 267,0 | 200,5 | 333,8 | 345,0 |

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

| Sectores | 29 de jul. al 2 de agosto | | | | 5 al 9 de agosto | | | | 12 al 16 de agosto | | | |
|----------------------------|---------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 16 | 62 | 3513 | 3383 | 16 | 68 | 2911 | 3126 | 17 | 165 | 3042 | 2751 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 1 | 1899 | 1370 | 0 | 0 | 1706 | 885 | 0 | 0 | 1684 | 1186 |
| Otros | 62 | 15 | 388 | 1047 | 68 | 16 | 477 | 1084 | 165 | 17 | 521 | 1309 |
| Total | 78 | 78 | 5800 | 5800 | 84 | 84 | 5094 | 5094 | 182 | 182 | 5246 | 5246 |

* 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.