

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1506,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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 | 363,6 | 148,8 | 123,0 | 206,6 | 15,8 | 147,0 | 10,0 |
| 15-35 | 587,1 | 492,3 | 176,6 | 235,0 | 31,7 | 68,1 | 284,0 |
| 36-60 | 3,0 | 9,6 | 0,0 | 0,0 | 8,4 | 1,8 | 1,2 |
| 61-90 | 32,6 | 30,8 | 0,9 | 0,0 | 13,3 | 16,0 | 16,6 |
| 91-180 | 12,6 | 97,4 | 51,6 | 0,0 | 34,5 | 1,3 | 11,3 |
| >180 | 20,0 | 51,8 | 25,0 | 0,0 | 6,8 | 0,0 | 20,0 |
| Total | 1018,9 | 830,7 | 377,1 | 441,6 | 110,6 | 234,2 | 343,1 |

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

*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 | 5 al 9 de agosto | | | | 12 al 16 de agosto | | | | 19 al 23 de agosto | | | |
|---------------------------|------------------|-----------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 17 | 68 | 3367 | 3302 | 18 | 187 | 3730 | 3252 | 9 | 94 | 2258 | 2624 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1719 | 1162 | 6 | 0 | 2079 | 1675 | 0 | 0 | 1821 | 610 |
| Otros | 68 | 17 | 476 | 1096 | 182 | 18 | 549 | 1431 | 94 | 9 | 293 | 1138 |
| Total | 85 | 85 | 5561 | 5561 | 206 | 206 | 6358 | 6358 | 104 | 104 | 4372 | 4372 |

* 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.