

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1378,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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 | 278,5 | 210,9 | 124,9 | 113,4 | 26,0 | 105,1 | 60,0 |
| 15-35 | 545,9 | 430,6 | 283,3 | 138,6 | 9,3 | 269,3 | 138,0 |
| 36-60 | 4,2 | 3,7 | 0,0 | 0,0 | 3,7 | 4,2 | 0,0 |
| 61-90 | 22,0 | 38,4 | 10,0 | 0,0 | 8,4 | 2,0 | 20,0 |
| 91-180 | 3,1 | 16,5 | 10,0 | 0,0 | 6,5 | 3,1 | 0,0 |
| >180 | 32,0 | 25,9 | 10,0 | 0,0 | 0,9 | 17,0 | 15,0 |
| Total | 885,7 | 726,0 | 438,2 | 252,0 | 54,8 | 400,7 | 233,0 |

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

*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 | 12 al 16 de agosto | | | | | | | | 19 al 23 de agosto | | | | 26 al 30 de agosto | | | |
|---------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|---|-----|---|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 185 | 4146 | 3571 | 11 | 101 | 2983 | 3012 | 27 | 93 | 2380 | 2330 | | | | |
| Intragrupa y off-shore*** | 6 | 0 | 2342 | 1971 | 0 | 0 | 1883 | 879 | 0 | 0 | 1523 | 869 | | | | |
| Otros | 180 | 22 | 555 | 1500 | 101 | 11 | 306 | 1279 | 93 | 27 | 393 | 1096 | | | | |
| Total | 207 | 207 | 7043 | 7043 | 112 | 112 | 5171 | 5171 | 120 | 120 | 4296 | 4296 | | | | |

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.