

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1609,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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 | 438,8 | 149,4 | 70,7 | 214,9 | 33,7 | 179,0 | 45,0 |
| 15-35 | 405,4 | 603,5 | 325,5 | 113,4 | 117,0 | 131,0 | 161,0 |
| 36-60 | 0,2 | 19,8 | 0,0 | 0,0 | 19,8 | 0,2 | 0,0 |
| 61-90 | 6,5 | 8,7 | 0,0 | 0,0 | 8,7 | 6,5 | 0,0 |
| 91-180 | 61,7 | 30,9 | 20,0 | 38,7 | 10,9 | 23,0 | 0,0 |
| >180 | 48,9 | 55,6 | 10,0 | 0,0 | 31,3 | 34,7 | 14,3 |
| Total | 961,6 | 867,9 | 426,2 | 367,0 | 221,4 | 374,4 | 220,3 |

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

*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

| Sector | 26 al 30 de agosto | | | | 2 al 6 de septiembre | | | | 9 al 13 de septiembre | | | |
|---------------------------|--------------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 486 | 544 | 3759 | 3190 | 12 | 92 | 3319 | 3279 | 5 | 61 | 3265 | 2893 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 4 | 1944 | 1576 | 0 | 1 | 1438 | 998 | 0 | 0 | 1251 | 752 |
| Otros | 544 | 481 | 478 | 1415 | 92 | 11 | 604 | 1083 | 61 | 5 | 553 | 1424 |
| Total | 1030 | 1030 | 6181 | 6181 | 105 | 105 | 5360 | 5360 | 67 | 67 | 5068 | 5068 |

* 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 intragrupo.