

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2013

Fecha de Información: 06 de diciembre 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\$1084,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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 | 238,9 | 105,4 | 36,6 | 21,6 | 9,0 | 157,5 | 59,8 |
| 15-35 | 325,7 | 204,2 | 132,0 | 212,4 | 12,2 | 53,3 | 60,0 |
| 36-60 | 149,3 | 82,1 | 36,7 | 0,0 | 45,4 | 149,3 | 0,0 |
| 61-90 | 24,1 | 15,2 | 0,0 | 0,0 | 5,2 | 14,1 | 10,0 |
| 91-180 | 3,2 | 17,7 | 0,0 | 0,0 | 17,7 | 3,2 | 0,0 |
| >180 | 6,7 | 47,4 | 0,0 | 0,0 | 41,4 | 0,7 | 6,0 |
| Total | 747,8 | 472,0 | 205,3 | 234,0 | 130,9 | 378,1 | 135,8 |

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

*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 | 2 al 6 de diciembre | | | | 9 al 13 de diciembre | | | | 16 al 20 de diciembre | | | |
|---------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 24 | 76 | 4791 | 4633 | 20 | 85 | 3394 | 3565 | 19 | 127 | 3262 | 3739 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 1 | 2242 | 1437 | 0 | 0 | 1587 | 927 | 0 | 0 | 1532 | 577 |
| Otros | 76 | 23 | 440 | 1403 | 85 | 20 | 675 | 1164 | 127 | 19 | 571 | 1048 |
| Total | 100 | 100 | 7473 | 7473 | 105 | 105 | 5656 | 5656 | 147 | 147 | 5365 | 5365 |

* 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.