

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2015

Fecha de Información: 27 de mayo de 2015 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\$1668.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.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 | 215.9 | 211.3 | 120.0 | 81.3 | 21.2 | 64.6 | 70.0 |
| 15-35 | 385.8 | 487.3 | 294.7 | 141.9 | 93.6 | 145.0 | 99.0 |
| 36-60 | 7.2 | 68.8 | 23.0 | 0.0 | 45.8 | 7.2 | 0.0 |
| 61-90 | 92.7 | 41.0 | 0.0 | 60.0 | 16.0 | 7.7 | 25.0 |
| 91-180 | 187.6 | 104.8 | 0.0 | 0.0 | 84.8 | 167.6 | 20.0 |
| >180 | 76.8 | 43.2 | 0.0 | 30.0 | 3.2 | 6.8 | 40.0 |
| Total | 966.1 | 956.5 | 437.8 | 313.2 | 264.7 | 398.9 | 254.0 |

* 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 | 3.6 % | 3.9 % | 3.2 % | 3.5 % |
| 15-35 | 3.6 % | 3.8 % | 3.4 % | 3.6 % |
| 36-60 | - | 3.9 % | 2.9 % | 3.8 % |
| 61-90 | 2.6 % | 4.3 % | 3.5 % | 3.4 % |
| 91-180 | 4.0 % | 4.1 % | 3.3 % | 3.6 % |
| >180 | 3.7 % | 4.9 % | 8.4 % | 5.9 % |
| Total | 3.5 % | 3.9 % | 3.7 % | 3.7 % |

*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 | 25 al 29 de mayo | | | | 1 al 5 de junio | | | | 8 al 12 de junio | | | |
|---------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 38 | 98 | 3181 | 2974 | 10 | 77 | 3084 | 3289 | 22 | 127 | 3149 | 3992 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 18 | 1441 | 1079 | 0 | 0 | 2216 | 894 | 0 | 0 | 2496 | 664 |
| Otros | 98 | 20 | 783 | 1351 | 77 | 10 | 423 | 1540 | 127 | 22 | 677 | 1666 |
| Total | 136 | 136 | 5404 | 5404 | 87 | 87 | 5722 | 5722 | 149 | 149 | 6322 | 6322 |

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