

Fecha de Publicación: 7 de julio de 2015

Fecha de Información: 03 de julio de viernes 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\$423.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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 | 169.9 | 198.8 | 95.5 | 57.8 | 15.3 | 24.1 | 88.0 |
| 15-35 | 54.7 | 101.2 | 61.0 | 0.0 | 10.2 | 24.7 | 30.0 |
| 36-60 | 2.3 | 4.7 | 0.0 | 0.0 | 4.7 | 2.3 | 0.0 |
| 61-90 | 3.4 | 0.9 | 0.0 | 0.0 | 0.9 | 3.4 | 0.0 |
| 91-180 | 1.7 | 3.1 | 0.0 | 0.0 | 3.1 | 1.7 | 0.0 |
| >180 | 0.1 | 0.7 | 0.0 | 0.0 | 0.7 | 0.1 | 0.0 |
| Total | 232.2 | 309.4 | 156.5 | 57.8 | 34.9 | 56.5 | 118.0 |

* 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 | 3.3 % | 4.4 % | 3.8 % | 3.9 % |
| 15-35 | 4.3 % | 5.1 % | 2.1 % | 4.2 % |
| 36-60 | - | 4.4 % | 3.7 % | 4.2 % |
| 61-90 | - | 4.2 % | 3.8 % | 3.9 % |
| 91-180 | - | 3.9 % | 3.6 % | 3.8 % |
| >180 | - | 4.6 % | 3.2 % | 4.4 % |
| Total | 3.5 % | 4.7 % | 3.4 % | 4.0 % |

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 29 de jun. al 3 de julio | | | | 6 al 10 de julio | | | | 13 al 17 de julio | | | |
|-----------------------------------|--------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 11 | 60 | 3836 | 3563 | 25 | 92 | 3193 | 3569 | 19 | 119 | 3213 | 3006 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2159 | 1861 | 0 | 0 | 2054 | 1288 | 0 | 0 | 2035 | 676 |
| Otros | 60 | 11 | 426 | 997 | 92 | 25 | 812 | 1201 | 119 | 19 | 303 | 1870 |
| Total | 71 | 71 | 6421 | 6421 | 116 | 116 | 6059 | 6059 | 139 | 139 | 5552 | 5552 |

* 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.