

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2015

Fecha de Información: 14 de julio de martes 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\$1768.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 328.3 | 269.3 | 99.4 | 148.9 | 10.9 | 20.4 | 159.0 |
| 15-35 | 392.4 | 530.8 | 325.4 | 161.0 | 41.4 | 67.4 | 164.0 |
| 36-60 | 260.5 | 7.2 | 4.0 | 0.0 | 3.2 | 260.5 | 0.0 |
| 61-90 | 30.4 | 48.2 | 0.0 | 0.0 | 18.2 | 0.4 | 30.0 |
| 91-180 | 120.2 | 71.9 | 60.0 | 0.0 | 11.9 | 120.2 | 0.0 |
| >180 | 25.9 | 50.9 | 27.2 | 0.0 | 8.8 | 10.9 | 15.0 |
| Total | 1157.7 | 978.4 | 516.0 | 309.9 | 94.4 | 479.8 | 368.0 |

* 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 | 2.9 % | 3.4 % | 2.1 % | 2.7 % |
| 15-35 | 3.6 % | 3.9 % | 3.5 % | 3.7 % |
| 36-60 | - | 4.2 % | 3.7 % | 3.7 % |
| 61-90 | 3.6 % | 3.9 % | 3.3 % | 3.7 % |
| 91-180 | - | 4.0 % | 3.6 % | 3.7 % |
| >180 | 3.7 % | 3.7 % | 3.6 % | 3.7 % |
| Total | 3.3 % | 3.8 % | 3.3 % | 3.5 % |

* 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 | 13 al 17 de julio | | | | 20 al 24 de julio | | | | 27 al 31 de julio | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 30 | 130 | 4269 | 3748 | 28 | 140 | 2380 | 2464 | 6 | 103 | 1931 | 2419 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2403 | 1419 | 0 | 0 | 1479 | 718 | 0 | 0 | 1481 | 525 |
| Otros | 129 | 30 | 456 | 1961 | 140 | 28 | 365 | 1042 | 102 | 6 | 485 | 953 |
| Total | 160 | 160 | 7128 | 7128 | 167 | 167 | 4224 | 4224 | 109 | 109 | 3897 | 3897 |

* 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.