

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1345.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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 | 343.2 | 184.4 | 69.0 | 213.5 | 41.4 | 55.7 | 74.0 |
| 15-35 | 336.1 | 335.1 | 250.0 | 196.9 | 24.1 | 78.2 | 61.0 |
| 36-60 | 38.4 | 77.0 | 35.1 | 0.0 | 41.9 | 38.4 | 0.0 |
| 61-90 | 9.1 | 14.8 | 0.1 | 0.0 | 14.7 | 9.1 | 0.0 |
| 91-180 | 48.4 | 91.0 | 35.0 | 0.0 | 38.5 | 30.9 | 17.5 |
| >180 | 12.6 | 20.2 | 0.0 | 0.0 | 8.2 | 0.6 | 12.0 |
| Total | 787.8 | 722.4 | 389.1 | 410.4 | 168.8 | 212.9 | 164.5 |

* 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 | 3.8 % | 5.2 % | 3.2 % | 3.8 % |
| 15-35 | 4.2 % | 4.1 % | 3.8 % | 4.0 % |
| 36-60 | - | 4.1 % | 3.7 % | 4.0 % |
| 61-90 | - | 4.2 % | 3.7 % | 4.0 % |
| 91-180 | 3.8 % | 3.6 % | 3.5 % | 3.6 % |
| >180 | 3.6 % | 4.1 % | 3.3 % | 3.8 % |
| Total | 3.9 % | 4.3 % | 3.5 % | 3.9 % |

*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 | 20 al 24 de julio | | | | 27 al 31 de julio | | | | 3 al 7 de agosto | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 26 | 139 | 3008 | 3078 | 13 | 105 | 2302 | 2908 | 8 | 76 | 2212 | 2872 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1726 | 1022 | 0 | 0 | 1625 | 594 | 0 | 0 | 2079 | 885 |
| Otros | 139 | 26 | 464 | 1098 | 104 | 13 | 667 | 1094 | 76 | 8 | 378 | 913 |
| Total | 165 | 165 | 5197 | 5197 | 118 | 118 | 4595 | 4595 | 84 | 84 | 4669 | 4669 |

* 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.