

Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2015

Fecha de Información: 03 de agosto de lunes 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\$1662.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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 | 584.1 | 275.8 | 68.5 | 267.0 | 15.8 | 125.6 | 191.5 |
| 15-35 | 357.6 | 444.8 | 248.1 | 205.6 | 100.8 | 56.0 | 96.0 |
| 36-60 | 42.4 | 39.4 | 0.0 | 0.0 | 39.4 | 42.4 | 0.0 |
| 61-90 | 0.2 | 8.6 | 0.0 | 0.0 | 8.6 | 0.2 | 0.0 |
| 91-180 | 8.4 | 62.6 | 0.0 | 0.0 | 62.6 | 8.4 | 0.0 |
| >180 | 3.0 | 123.0 | 115.0 | 0.0 | 8.0 | 3.0 | 0.0 |
| Total | 995.7 | 954.2 | 431.6 | 472.6 | 235.1 | 235.7 | 287.5 |

* 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 | 0.0 % | 1.8 % | 1.4 % | 1.0 % |
| 15-35 | 1.7 % | 1.3 % | 1.2 % | 1.3 % |
| 36-60 | - | 2.5 % | 1.5 % | 2.0 % |
| 61-90 | - | 2.9 % | 2.3 % | 2.9 % |
| 91-180 | - | 3.0 % | 2.4 % | 2.9 % |
| >180 | - | 3.1 % | 2.5 % | 3.1 % |
| Total | 0.6 % | 2.0 % | 1.3 % | 1.5 % |

* 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 | 3 al 7 de agosto | | | | 10 al 14 de agosto | | | | 17 al 21 de agosto | | | |
|-----------------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 49 | 84 | 3630 | 3711 | 21 | 109 | 3947 | 3679 | 12 | 103 | 2502 | 2565 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2231 | 1660 | 0 | 0 | 2253 | 1104 | 0 | 0 | 1641 | 582 |
| Otros | 84 | 49 | 586 | 1076 | 109 | 21 | 511 | 1928 | 103 | 12 | 458 | 1454 |
| Total | 133 | 133 | 6447 | 6447 | 130 | 130 | 6711 | 6711 | 116 | 116 | 4601 | 4601 |

* 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.