

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2015

Fecha de Información: 04 de agosto 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\$1943.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	511.7	192.9	38.0	295.5	64.9	126.2	90.0
15-35	447.4	548.3	388.1	255.7	110.2	141.8	49.9
36-60	9.1	52.9	13.0	0.0	39.9	9.1	0.0
61-90	1.2	76.2	0.0	0.0	76.2	1.2	0.0
91-180	83.7	123.6	80.0	0.0	23.6	63.7	20.0
>180	7.7	48.4	43.0	0.0	5.4	7.7	0.0
Total	1060.9	1042.3	562.1	551.2	320.3	349.8	159.9

* 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	1.0 %	0.6 %	2.5 %	1.8 %
15-35	0.5 %	2.0 %	1.2 %	1.6 %
36-60	-	2.6 %	1.6 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	1.9 %	2.7 %
91-180	2.9 %	3.0 %	2.4 %	2.8 %
>180	-	3.1 %	2.9 %	3.1 %
Total	1.1 %	2.1 %	1.9 %	1.9 %

* 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	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**	50	83	3946	3776	21	113	4137	3799	13	105	2630	2599
Intragruppo y off-shore***	0	0	2248	1936	0	0	2274	1123	0	0	1643	651
Otros	83	50	604	1086	113	21	549	2038	105	13	470	1493
Total	133	133	6798	6798	133	133	6960	6960	118	118	4743	4743

* 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.