

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1987.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	569.5	329.7	33.0	206.8	44.7	110.7	252.0
15-35	412.8	435.5	142.0	169.4	143.5	93.3	150.0
36-60	29.4	18.4	0.0	20.0	18.4	9.4	0.0
61-90	73.1	10.9	0.0	0.0	10.9	73.1	0.0
91-180	23.4	125.4	20.0	20.0	105.4	3.4	0.0
>180	22.7	348.4	0.0	0.0	338.4	12.7	10.0
Total	1130.9	1268.3	195.0	416.2	661.3	302.7	412.0

* 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	0.0 %	1.8 %	1.4 %	0.9 %
15-35	1.0 %	1.6 %	1.0 %	1.3 %
36-60	-	2.9 %	0.8 %	1.6 %
61-90	3.2 %	3.4 %	2.6 %	2.7 %
91-180	-	3.0 %	2.6 %	2.9 %
>180	3.0 %	3.1 %	2.7 %	3.1 %
Total	0.4 %	2.5 %	1.5 %	1.7 %

*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	10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	108	4929	4196	19	111	3167	2889	22	830	3257	2596
Intragruppo y off-shore***	0	0	2340	1572	0	0	1703	900	0	0	1363	1193
Otros	108	25	612	2113	111	19	523	1604	830	22	534	1365
Total	132	132	7881	7881	131	131	5392	5392	853	853	5155	5155

* 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.