

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2015

Fecha de Información: 11 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\$1826.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	351.0	248.0	99.5	220.5	68.0	50.0	80.5
15-35	607.5	469.3	338.0	159.5	23.3	340.0	108.0
36-60	102.8	24.7	0.0	30.0	4.4	52.5	20.3
61-90	27.1	5.4	0.0	0.5	5.4	26.6	0.0
91-180	43.9	56.8	40.0	20.0	16.8	23.9	0.0
>180	48.1	74.1	41.4	0.0	9.2	24.6	23.5
Total	1180.4	878.2	518.9	430.5	127.0	517.6	232.3

* 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	0.9 %	1.5 %	0.5 %	1.0 %
15-35	1.2 %	1.2 %	0.6 %	0.9 %
36-60	2.3 %	3.3 %	1.8 %	2.0 %
61-90	-	3.2 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	3.4 %	2.5 %	2.7 %
>180	2.9 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
Total	1.3 %	1.6 %	1.0 %	1.2 %

*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	5173	4255	23	116	3241	2957	23	881	3386	2708
Intragruppo y off-shore***	0	0	2369	1778	0	0	1721	900	0	0	1435	1259
Otros	108	25	613	2121	116	23	531	1636	881	23	540	1393
Total	133	133	8155	8155	139	139	5493	5493	904	904	5360	5360

* 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.