

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2015

Fecha de Información: 12 de agosto de miércoles 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\$1569.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	460.8	253.7	86.8	245.7	60.0	108.1	107.0
15-35	387.5	492.9	313.0	25.0	92.9	275.5	87.0
36-60	5.3	4.8	0.0	0.0	4.8	5.3	0.0
61-90	37.9	7.5	0.0	0.0	7.5	37.9	0.0
91-180	68.3	22.4	10.0	0.0	12.4	68.3	0.0
>180	3.1	18.8	15.0	0.0	3.8	3.1	0.0
Total	962.9	800.1	424.8	270.7	181.3	498.2	194.0

* 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	0.8 %	1.4 %	0.6 %	0.9 %
15-35	1.2 %	1.2 %	0.8 %	1.0 %
36-60	-	3.3 %	0.9 %	2.0 %
61-90	-	3.2 %	2.4 %	2.5 %
91-180	-	3.3 %	2.3 %	2.5 %
>180	-	3.0 %	2.8 %	3.0 %
Total	1.0 %	1.5 %	1.0 %	1.1 %

* 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**	40	107	5369	4290	23	117	3330	3042	23	931	3573	2817
Intragrupa y off-shore***	0	0	2384	1971	0	0	1772	928	0	0	1455	1283
Otros	107	40	618	2110	117	23	533	1666	930	23	566	1494
Total	148	148	8371	8371	140	140	5636	5636	954	954	5594	5594

* 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.