

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2015

Fecha de Información: 13 de agosto de jueves 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\$1654.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	277.1	152.8	41.0	179.5	57.8	43.6	54.0
15-35	530.3	599.8	419.8	71.0	55.6	334.8	124.5
36-60	36.7	2.4	0.0	2.5	1.4	33.2	1.0
61-90	32.1	8.0	0.0	20.0	2.0	6.1	6.0
91-180	62.1	67.9	0.0	0.0	67.9	62.1	0.0
>180	54.9	35.4	10.0	1.5	5.4	33.4	20.0
Total	993.2	866.3	470.8	274.5	190.1	513.2	205.5

* 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	1.2 %	1.7 %	0.6 %	1.0 %
15-35	1.2 %	1.3 %	0.8 %	1.1 %
36-60	1.9 %	2.2 %	1.2 %	1.3 %
61-90	2.2 %	3.3 %	2.2 %	2.3 %
91-180	-	3.2 %	2.4 %	2.8 %
>180	3.2 %	3.4 %	3.0 %	3.1 %
Total	1.4 %	1.6 %	1.1 %	1.3 %

*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	105	5446	4289	25	140	3410	3076	26	980	3694	2864
Intragrupa y off-shore***	0	0	2384	2048	0	0	1787	958	0	0	1481	1356
Otros	105	40	617	2110	140	25	517	1681	980	26	569	1524
Total	146	146	8448	8448	165	165	5715	5715	1006	1006	5744	5744

* 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.