

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1851.5 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	532.4	382.4	129.5	291.8	99.9	87.7	153.0
15-35	510.0	325.0	172.0	157.3	30.0	229.7	123.0
36-60	42.4	73.8	10.0	0.0	53.8	32.4	10.0
61-90	2.9	40.3	0.0	0.0	40.3	2.9	0.0
91-180	80.0	79.7	66.5	0.0	13.2	80.0	0.0
>180	42.9	45.8	20.0	0.0	5.8	22.9	20.0
Total	1210.5	946.9	398.0	449.0	242.9	455.5	306.0

* 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	0.7 %	1.9 %	0.7 %	1.1 %
15-35	1.0 %	1.3 %	0.9 %	1.0 %
36-60	2.0 %	2.2 %	1.6 %	2.0 %
61-90	-	2.4 %	1.7 %	2.4 %
91-180	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
>180	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
Total	1.0 %	2.0 %	1.0 %	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	17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	140	3908	3273	28	1102	3865	3116	5	106	2253	2822
Intragruppo y off-shore***	0	0	1854	1310	0	0	1588	1386	0	0	1919	940
Otros	140	26	541	1720	1102	28	580	1530	106	5	389	799
Total	166	166	6304	6304	1130	1130	6033	6033	110	110	4561	4561

* 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.