

Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2015

Fecha de Información: 19 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\$2110.2 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	453.4	225.1	75.1	321.7	79.1	60.7	71.0
15-35	532.5	556.3	426.7	255.0	36.6	184.5	93.0
36-60	51.8	11.7	0.0	0.0	11.7	51.8	0.0
61-90	45.2	71.6	25.7	20.0	20.9	0.2	25.0
91-180	56.1	137.9	119.6	0.0	18.3	56.1	0.0
>180	76.1	112.9	64.2	11.5	17.2	33.1	31.5
Total	1215.1	1115.5	711.2	608.2	183.8	386.4	220.5

* 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	0.7 %	1.9 %	0.7 %	1.0 %
15-35	1.0 %	0.8 %	0.9 %	0.9 %
36-60	-	1.2 %	1.0 %	1.0 %
61-90	2.0 %	2.1 %	1.1 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	2.3 %	2.3 %
>180	3.0 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
Total	1.3 %	1.5 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	144	4184	3354	28	1106	3995	3181	5	106	2380	2952		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1896	1545	0	0	1618	1473	0	0	1949	940		
Otros	144	26	559	1740	1106	28	605	1564	106	5	420	857		
Total	170	170	6639	6639	1133	1133	6218	6218	110	110	4749	4749		

* 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.

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.