

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2015

Fecha de Información: 20 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\$2213.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	395.9	233.9	107.5	194.3	27.9	103.1	98.5
15-35	608.9	533.5	365.8	360.0	45.7	126.9	122.0
36-60	20.8	48.3	0.0	5.0	48.3	15.8	0.0
61-90	48.1	40.6	30.0	45.0	9.2	1.7	1.4
91-180	76.3	249.1	235.0	1.7	14.1	74.6	0.0
>180	143.7	145.5	20.0	27.2	16.5	7.5	109.0
Total	1293.6	1250.9	758.3	633.2	161.7	329.6	330.9

* 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 %	1.1 %	0.7 %	0.8 %
15-35	0.7 %	1.2 %	0.6 %	0.9 %
36-60	-	1.9 %	1.0 %	1.6 %
61-90	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	2.3 %	2.1 %	2.3 %
>180	3.2 %	3.0 %	3.0 %	3.1 %
Total	1.5 %	1.6 %	0.9 %	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	143	4250	3367	27	1110	4165	3220	5	107	2614	3207
Intragruppo y off-shore***	0	0	1896	1594	0	0	1644	1606	0	0	2047	962
Otros	143	26	566	1751	1110	27	615	1598	107	5	428	920
Total	169	169	6712	6712	1136	1136	6424	6424	112	112	5089	5089

* 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.