

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2015

Fecha de Información: 25 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\$2038.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.1%.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	420.7	338.2	112.6	132.0	27.5	90.7	198.0
15-35	642.8	567.0	349.5	281.0	56.5	200.8	161.0
36-60	107.4	66.8	29.0	20.0	12.6	62.2	25.2
61-90	23.7	14.1	0.0	0.0	14.1	23.7	0.0
91-180	22.0	85.6	56.0	1.5	14.6	5.6	15.0
>180	90.3	84.0	50.0	61.5	9.0	3.8	25.0
Total	1306.9	1155.8	597.1	496.0	134.4	386.8	424.2

* 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	-1.7 %	0.5 %	-0.4 %	-0.6 %
15-35	0.1 %	0.0 %	-0.5 %	-0.2 %
36-60	1.2 %	1.4 %	0.9 %	1.1 %
61-90	-	2.3 %	0.8 %	1.4 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.6 %	2.8 %
Total	-	0.7 %	0.0 %	0.1 %

*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	24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	1111	4792	3664	6	120	3101	3445	18	98	2064	2167
Intragrupa y off-shore***	0	0	1727	1906	0	0	2148	1172	0	0	1402	569
Otros	1111	27	751	1700	120	6	472	1103	98	18	438	1168
Total	1138	1138	7270	7270	127	127	5721	5721	117	117	3904	3904

* 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.