

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2015

Fecha de Información: 27 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\$1764.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	437.6	265.9	96.0	214.5	137.9	191.1	32.0
15-35	533.4	212.4	161.5	264.3	25.9	244.2	25.0
36-60	36.4	18.4	0.1	0.0	17.5	35.6	0.8
61-90	62.8	78.2	39.3	10.0	23.9	37.8	15.0
91-180	40.8	77.9	20.0	0.0	57.9	40.8	0.0
>180	5.7	68.0	54.0	0.9	14.0	4.8	0.0
Total	1116.7	720.8	370.8	489.7	277.2	554.3	72.8

* 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 %	1.7 %	0.5 %	0.8 %
15-35	0.7 %	-0.8 %	0.8 %	0.4 %
36-60	1.0 %	2.5 %	0.7 %	1.3 %
61-90	2.4 %	2.3 %	1.3 %	1.9 %
91-180	-	2.9 %	2.1 %	2.6 %
>180	-	3.2 %	3.2 %	3.2 %
Total	1.1 %	1.4 %	0.8 %	1.0 %

*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	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**	24	1102	5149	3785	11	135	3442	3669	22	100	2363	2238
Intragruppo y off-shore***	0	0	1741	2190	0	0	2259	1322	0	0	1402	696
Otros	1102	24	813	1729	135	11	514	1224	100	22	498	1330
Total	1126	1126	7703	7703	146	146	6214	6214	122	122	4264	4264

* 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.