

Fecha de Publicación: 2 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 31 de agosto de lunes 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\$1416.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	298.9	191.5	53.4	177.0	77.7	61.5	60.4
15-35	317.3	373.2	157.9	149.7	170.3	122.6	45.0
36-60	16.1	21.0	0.0	0.0	21.0	16.1	0.0
61-90	3.4	14.5	0.0	0.0	14.5	3.4	0.0
91-180	75.2	94.7	0.0	0.0	84.7	65.2	10.0
>180	82.3	93.7	25.0	6.2	18.7	26.1	50.0
Total	793.2	788.6	236.3	332.9	386.9	294.9	165.4

* 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	0.5 %	0.7 %	0.3 %	0.4 %
15-35	0.8 %	1.4 %	1.4 %	1.3 %
36-60	-	2.3 %	1.1 %	1.8 %
61-90	-	2.7 %	0.8 %	2.3 %
91-180	2.3 %	3.1 %	2.0 %	2.6 %
>180	3.2 %	3.4 %	2.8 %	3.2 %
Total	1.5 %	1.7 %	1.1 %	1.4 %

*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	31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	163	3854	3930	23	100	2663	2368	15	133	2448	2787
Intragrupa y off-shore***	0	0	2322	1541	0	0	1432	787	0	0	1721	662
Otros	163	12	604	1308	100	23	541	1482	133	15	490	1208
Total	174	174	6779	6779	123	123	4636	4636	148	148	4658	4658

* 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.