

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$1832.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	442.0	299.1	187.0	293.0	26.1	63.0	86.0
15-35	345.0	492.6	389.5	242.4	63.1	62.6	40.0
36-60	32.2	59.0	40.0	0.0	19.0	32.2	0.0
61-90	4.2	22.1	8.0	0.0	14.1	4.2	0.0
91-180	93.6	44.2	10.0	40.0	14.2	33.6	20.0
>180	102.6	127.7	37.3	10.0	4.4	6.6	86.0
Total	1019.7	1044.8	671.8	585.4	141.0	202.2	232.0

* 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	0.6 %	0.9 %	0.6 %	0.7 %
15-35	0.7 %	0.9 %	0.2 %	0.7 %
36-60	-	2.0 %	0.8 %	1.6 %
61-90	-	3.0 %	1.9 %	2.8 %
91-180	2.7 %	3.1 %	2.5 %	2.7 %
>180	3.3 %	3.4 %	2.9 %	3.3 %
Total	1.8 %	1.3 %	0.9 %	1.2 %

*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**	14	165	4055	4039	23	99	2836	2435	15	133	2642	2956
Intragruppo y off-shore***	0	0	2371	1682	0	0	1470	910	0	0	1843	804
Otros	165	14	612	1317	99	23	556	1517	133	15	506	1231
Total	179	179	7039	7039	123	123	4862	4862	148	148	4991	4991

* 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.