

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 02 de septiembre de miércoles 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\$1663.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	524.8	305.4	75.0	265.3	38.4	67.6	192.0
15-35	346.8	537.7	373.8	114.5	54.4	122.8	109.5
36-60	48.6	111.0	70.0	0.0	31.0	38.6	10.0
61-90	3.5	1.7	0.0	0.0	1.7	3.5	0.0
91-180	45.9	6.1	0.1	30.0	6.1	15.9	0.0
>180	23.3	40.5	10.0	0.0	10.5	3.3	20.0
Total	992.9	1002.4	528.8	409.8	142.1	251.7	331.5

* 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	1.3 %	1.9 %	1.9 %	1.7 %
15-35	-1.1 %	-1.5 %	0.7 %	-0.7 %
36-60	1.9 %	1.9 %	1.1 %	1.7 %
61-90	-	3.3 %	2.2 %	2.5 %
91-180	-	4.0 %	2.8 %	2.9 %
>180	1.6 %	4.0 %	2.9 %	2.8 %
Total	0.6 %	-0.1 %	1.5 %	0.6 %

*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	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	164	4317	4127	24	100	2912	2562	20	133	2828	3070
Intragrupa y off-shore***	0	0	2384	1846	0	0	1532	927	0	0	1866	888
Otros	164	14	636	1365	100	24	560	1515	133	20	516	1252
Total	178	178	7338	7338	124	124	5004	5004	153	153	5210	5210

* 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.