

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 03 de septiembre 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\$1628.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	332.2	332.8	171.3	100.5	78.5	148.7	83.0
15-35	338.9	429.7	322.3	73.6	46.4	204.3	61.0
36-60	59.5	12.9	0.0	0.0	12.9	59.5	0.0
61-90	10.7	17.3	0.1	0.0	7.2	0.7	10.0
91-180	148.2	50.1	13.0	90.0	27.1	48.2	10.0
>180	44.6	40.2	1.0	10.0	14.2	9.6	25.0
Total	934.1	883.0	507.7	274.1	186.3	471.0	189.0

* 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	2.0 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
15-35	3.0 %	1.5 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.7 %	1.3 %	1.6 %
61-90	2.3 %	3.6 %	-0.8 %	2.7 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.9 %	2.9 %
>180	3.8 %	4.2 %	2.9 %	3.6 %
Total	2.6 %	1.9 %	1.8 %	2.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	4368	4215	26	101	3066	2735	20	133	2972	3164
Intragruppo y off-shore***	0	0	2414	1848	0	0	1675	1012	0	0	1887	902
Otros	165	14	679	1398	101	26	571	1565	133	20	541	1334
Total	179	179	7461	7461	127	127	5312	5312	153	153	5399	5399

* 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.