

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2015

Fecha de Información: 12 de agosto de miércoles¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1569.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|--------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 460.8 | 253.7 | 86.8 | 245.7 | 60.0 | 108.1 | 107.0 |
| 15-35 | 387.5 | 492.9 | 313.0 | 25.0 | 92.9 | 275.5 | 87.0 |
| 36-60 | 5.3 | 4.8 | 0.0 | 0.0 | 4.8 | 5.3 | 0.0 |
| 61-90 | 37.9 | 7.5 | 0.0 | 0.0 | 7.5 | 37.9 | 0.0 |
| 91-180 | 68.3 | 22.4 | 10.0 | 0.0 | 12.4 | 68.3 | 0.0 |
| >180 | 3.1 | 18.8 | 15.0 | 0.0 | 3.8 | 3.1 | 0.0 |
| Total | 962.9 | 800.1 | 424.8 | 270.7 | 181.3 | 498.2 | 194.0 |

* 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 intragruo | | Total |
|--------------|--------------------|-----------------------------|--------------|--------------|
| | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 0.8 % | 1.4 % | 0.6 % | 0.9 % |
| 15-35 | 1.2 % | 1.2 % | 0.8 % | 1.0 % |
| 36-60 | - | 3.3 % | 0.9 % | 2.0 % |
| 61-90 | - | 3.2 % | 2.4 % | 2.5 % |
| 91-180 | - | 3.3 % | 2.3 % | 2.5 % |
| >180 | - | 3.0 % | 2.8 % | 3.0 % |
| Total | 1.0 % | 1.5 % | 1.0 % | 1.1 % |

*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 10 al 14 de agosto | | | | 17 al 21 de agosto | | | | 24 al 28 de agosto | | | |
|----------------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 40 | 107 | 5369 | 4290 | 23 | 117 | 3330 | 3042 | 23 | 931 | 3573 | 2817 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2384 | 1971 | 0 | 0 | 1772 | 928 | 0 | 0 | 1455 | 1283 |
| Otros | 107 | 40 | 618 | 2110 | 117 | 23 | 533 | 1666 | 930 | 23 | 566 | 1494 |
| Total | 148 | 148 | 8371 | 8371 | 140 | 140 | 5636 | 5636 | 954 | 954 | 5594 | 5594 |

* 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.