

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2015

Fecha de Información: 14 de agosto de viernes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$936.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.²

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	0.8 %	1.3 %	0.8 %	0.9 %
15-35	1.0 %	1.5 %	1.0 %	1.2 %
36-60	-	2.2 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	2.8 %	1.4 %	2.4 %
91-180	-	2.9 %	2.2 %	2.7 %
>180	3.2 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
Total	1.2 %	1.9 %	1.2 %	1.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	212.5	194.7	44.0	95.0	63.7	30.5	87.0
15-35	208.9	223.3	132.0	67.0	14.3	64.9	77.0
36-60	25.3	7.3	0.0	0.0	7.3	25.3	0.0
61-90	2.0	6.1	0.0	0.0	6.1	2.0	0.0
91-180	40.7	68.2	20.0	15.0	48.2	25.7	0.0
>180	40.3	90.5	60.0	3.8	11.0	17.0	19.5
Total	529.6	590.2	256.0	180.8	150.7	165.3	183.5

* 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.

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 intragrupo.

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	103	5446	4297	26	139	3589	3191	26	1031	3724	2893
Intragrupo y off-shore***	0	0	2384	2048	0	0	1816	1035	0	0	1496	1374
Otros	103	40	625	2110	139	26	527	1706	1031	26	572	1525
Total	144	144	8455	8455	165	165	5932	5932	1057	1057	5792	5792

* 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.