

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2015

Fecha de Información: 25 de agosto de martes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2038.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.1%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 420.7 | 338.2 | 112.6 | 132.0 | 27.5 | 90.7 | 198.0 |
| 15-35 | 642.8 | 567.0 | 349.5 | 281.0 | 56.5 | 200.8 | 161.0 |
| 36-60 | 107.4 | 66.8 | 29.0 | 20.0 | 12.6 | 62.2 | 25.2 |
| 61-90 | 23.7 | 14.1 | 0.0 | 0.0 | 14.1 | 23.7 | 0.0 |
| 91-180 | 22.0 | 85.6 | 56.0 | 1.5 | 14.6 | 5.6 | 15.0 |
| >180 | 90.3 | 84.0 | 50.0 | 61.5 | 9.0 | 3.8 | 25.0 |
| Total | 1306.9 | 1155.8 | 597.1 | 496.0 | 134.4 | 386.8 | 424.2 |

* 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 | |
| 3-14 | -1.7 % | 0.5 % | -0.4 % | -0.6 % |
| 15-35 | 0.1 % | 0.0 % | -0.5 % | -0.2 % |
| 36-60 | 1.2 % | 1.4 % | 0.9 % | 1.1 % |
| 61-90 | - | 2.3 % | 0.8 % | 1.4 % |
| 91-180 | 1.8 % | 1.9 % | 1.9 % | 1.9 % |
| >180 | 2.9 % | 3.0 % | 2.6 % | 2.8 % |
| Total | - | 0.7 % | 0.0 % | 0.1 % |

*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**

| Sectores | 24 al 28 de agosto | | | | 31 de ago. al 4 de septiembre | | | | 7 al 11 de septiembre | | | |
|---------------------------|--------------------|-------------|-------------|-------------|-------------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 27 | 1111 | 4792 | 3664 | 6 | 120 | 3101 | 3445 | 18 | 98 | 2064 | 2167 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1727 | 1906 | 0 | 0 | 2148 | 1172 | 0 | 0 | 1402 | 569 |
| Otros | 1111 | 27 | 751 | 1700 | 120 | 6 | 472 | 1103 | 98 | 18 | 438 | 1168 |
| Total | 1138 | 1138 | 7270 | 7270 | 127 | 127 | 5721 | 5721 | 117 | 117 | 3904 | 3904 |

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