

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2015

Fecha de Información: 26 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\$1505.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	443.1	151.6	26.0	301.8	42.1	57.9	83.4
15-35	344.3	464.3	335.9	68.0	42.0	189.9	86.4
36-60	8.3	36.5	0.0	0.0	36.5	8.3	0.0
61-90	15.2	18.5	0.1	1.0	8.4	4.2	10.0
91-180	78.7	29.0	9.5	0.0	9.6	68.7	10.0
>180	79.8	76.2	6.3	24.0	20.0	5.8	50.0
Total	969.5	776.1	377.6	394.8	158.6	334.9	239.9

* 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	0.5 %	2.8 %	-0.4 %	0.2 %
15-35	0.2 %	0.6 %	-0.1 %	0.3 %
36-60	-	1.4 %	0.2 %	1.2 %
61-90	1.5 %	5.9 %	0.5 %	2.8 %
91-180	2.1 %	3.4 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.9 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
Total	1.0 %	1.2 %	0.1 %	0.6 %

*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	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**	24	1102	5058	3739	8	125	3271	3501	18	99	2179	2193
Intragrupo y off-shore***	0	0	1738	2118	0	0	2163	1263	0	0	1402	596
Otros	1102	24	772	1712	125	8	472	1142	99	18	454	1246
Total	1126	1126	7568	7568	133	133	5906	5906	117	117	4035	4035

* 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.