

Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 28 de agosto de viernes 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\$1280.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	435.2	241.0	43.0	132.1	75.5	180.5	122.6
15-35	271.2	338.3	147.6	79.9	99.2	99.8	91.5
36-60	12.4	31.7	12.2	2.9	19.5	9.6	0.0
61-90	15.8	20.1	0.0	0.0	20.1	15.8	0.0
91-180	40.0	45.5	0.1	0.0	45.4	40.0	0.0
>180	32.9	10.1	0.1	0.0	10.1	32.9	0.0
Total	807.6	686.7	202.9	214.9	269.8	378.6	214.1

* 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	2.1 %	1.6 %	0.4 %	1.1 %
15-35	0.9 %	1.2 %	0.4 %	0.9 %
36-60	-	2.7 %	0.7 %	2.2 %
61-90	-	3.8 %	1.6 %	2.8 %
91-180	-	3.1 %	2.1 %	2.6 %
>180	-	3.4 %	3.0 %	3.1 %
Total	1.6 %	1.8 %	0.7 %	1.3 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	1100	5149	3785	12	144	3663	3839	23	101	2574	2317
Intragrupo y off-shore***	0	0	1741	2190	0	0	2294	1428	0	0	1410	722
Otros	1100	24	813	1729	144	12	583	1273	101	23	513	1458
Total	1123	1123	7703	7703	156	156	6541	6541	124	124	4497	4497

* 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.