

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 08 de septiembre de martes 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\$1711.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	375.7	336.8	256.6	311.9	47.2	30.9	33.0
15-35	506.4	288.0	209.9	179.8	42.6	291.1	35.5
36-60	71.5	43.5	29.0	7.0	14.5	64.5	0.0
61-90	7.4	12.2	0.0	0.0	12.2	7.4	0.0
91-180	73.4	31.2	0.0	0.0	25.7	67.9	5.5
>180	3.6	36.1	13.5	2.3	22.6	1.3	0.0
Total	1038.1	747.7	509.0	500.9	164.7	463.2	74.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	2.7 %	2.7 %	2.7 %
15-35	3.3 %	2.5 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.6 %	2.0 %	2.2 %
61-90	-	3.3 %	2.5 %	3.0 %
91-180	0.9 %	3.4 %	3.0 %	3.0 %
>180	-	3.8 %	3.4 %	3.7 %
Total	2.5 %	2.7 %	2.4 %	2.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	104	3446	3044	21	137	3234	3333	13	181	2408	2651
Intragrupa y off-shore***	0	0	1889	1295	0	0	1993	1079	0	0	1563	1014
Otros	104	33	617	1614	137	21	574	1388	181	13	617	923
Total	137	137	5952	5952	158	158	5801	5801	194	194	4588	4588

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.