

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 09 de septiembre de miércoles 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\$1986.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	517.8	285.3	161.5	338.2	18.8	74.6	105.0
15-35	519.5	568.8	505.8	73.0	42.6	426.0	20.5
36-60	15.9	5.0	0.0	0.2	5.0	15.8	0.0
61-90	2.9	36.2	0.0	0.0	36.2	2.9	0.0
91-180	84.6	49.7	30.0	75.7	17.4	6.6	2.3
>180	20.9	7.8	0.0	20.7	7.8	0.2	0.0
Total	1161.8	952.8	697.3	507.8	127.7	526.2	127.8

* 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	2.6 %	3.0 %	2.4 %	2.5 %
15-35	3.0 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %
36-60	-	4.0 %	2.6 %	3.0 %
61-90	-	3.3 %	2.4 %	3.2 %
91-180	0.0 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
>180	-	3.8 %	3.7 %	3.7 %
Total	2.6 %	3.3 %	2.7 %	2.9 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	3762	3211	21	137	3338	3401	13	182	2519	2701
Intragrupa y off-shore***	0	0	1975	1532	0	0	2036	1151	0	0	1596	1053
Otros	104	33	625	1618	137	21	573	1395	181	13	629	990
Total	137	137	6362	6362	157	157	5947	5947	195	195	4744	4744

* 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.