

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 10 de septiembre de jueves 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\$1826.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	319.5	164.3	79.0	179.5	38.3	93.0	47.0
15-35	515.7	483.8	358.0	100.5	48.7	338.2	77.0
36-60	15.4	55.1	20.0	0.0	35.1	15.4	0.0
61-90	44.4	34.6	0.0	0.0	34.6	44.4	0.0
91-180	77.8	190.6	80.0	35.0	95.6	27.8	15.0
>180	39.8	29.7	4.9	20.0	19.9	14.8	5.0
Total	1012.6	958.1	541.9	335.0	272.2	533.6	144.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	5.7 %	3.3 %	3.9 %
15-35	3.4 %	4.4 %	3.2 %	3.7 %
36-60	-	4.4 %	2.9 %	3.9 %
61-90	-	3.9 %	3.2 %	3.5 %
91-180	3.5 %	4.1 %	3.7 %	3.9 %
>180	3.9 %	3.9 %	3.5 %	3.7 %
Total	3.2 %	4.5 %	3.3 %	3.8 %

*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 intragruppo.

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**	34	105	3843	3238	21	137	3451	3497	13	182	2644	2758
Intragrupa y off-shore***	0	0	1983	1595	0	0	2096	1196	0	0	1607	1124
Otros	105	34	626	1619	137	21	594	1448	182	13	661	1030
Total	138	138	6452	6452	157	157	6141	6141	195	195	4912	4912

* 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.