

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 11 de septiembre 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\$1708.3 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	383.3	257.7	142.3	209.8	28.0	86.0	87.5
15-35	392.3	579.4	419.5	116.0	59.5	175.8	100.5
36-60	3.8	28.6	0.0	0.0	28.6	3.8	0.0
61-90	23.8	34.9	0.0	0.0	14.9	3.8	20.0
91-180	62.8	138.2	60.0	10.0	43.2	17.8	35.0
>180	28.4	23.1	0.0	20.0	18.1	3.4	5.0
Total	894.3	1062.0	621.7	355.8	192.3	290.5	248.0

* 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	2.0 %	3.3 %	1.6 %	2.0 %
15-35	2.8 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
36-60	-	4.7 %	2.4 %	4.4 %
61-90	1.8 %	4.1 %	3.0 %	2.8 %
91-180	3.8 %	4.0 %	3.5 %	3.8 %
>180	3.7 %	4.0 %	3.7 %	3.8 %
Total	2.6 %	3.4 %	2.4 %	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	102	3843	3238	19	139	3743	3731	13	183	2734	2778
Intragrupa y off-shore***	0	0	1983	1595	0	0	2236	1385	0	0	1609	1145
Otros	102	33	627	1619	139	19	600	1464	183	13	678	1097
Total	136	136	6453	6453	158	158	6579	6579	197	197	5020	5020

* 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.