

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 14 de septiembre de lunes 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\$1571.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	393.5	395.2	139.2	130.2	18.5	25.8	237.5
15-35	384.8	364.9	238.5	106.0	60.9	213.3	65.5
36-60	97.3	20.1	0.7	40.0	19.4	57.3	0.0
61-90	2.7	10.9	0.0	0.0	10.9	2.7	0.0
91-180	77.8	50.2	0.1	0.0	50.1	77.8	0.0
>180	52.5	25.0	1.5	40.0	23.5	12.5	0.0
Total	1008.6	866.3	380.0	316.2	183.3	389.4	303.0

* 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	2.8 %	3.1 %	2.7 %	2.8 %
15-35	2.5 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	4.2 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	4.2 %	3.1 %	4.0 %
91-180	-	4.1 %	3.2 %	3.6 %
>180	-	4.0 %	3.7 %	3.8 %
Total	2.7 %	3.3 %	2.9 %	3.0 %

*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	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	135	3916	3875	14	184	2943	3009	9	124	2218	2510
Intragrupa y off-shore***	0	0	2304	1481	0	0	1664	1180	0	0	1415	789
Otros	135	20	609	1473	184	14	684	1102	124	9	810	1144
Total	155	155	6828	6828	198	198	5290	5290	133	133	4444	4444

* 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.