

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 15 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\$1577.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	353.7	417.1	224.0	167.0	30.1	23.7	163.0
15-35	477.1	322.4	143.4	136.6	54.5	216.0	124.5
36-60	3.4	1.5	0.0	0.1	1.5	3.3	0.0
61-90	35.7	11.8	0.0	0.0	11.8	35.7	0.0
91-180	87.3	97.4	20.0	0.0	77.4	87.3	0.0
>180	29.5	27.7	16.0	0.0	11.7	29.5	0.0
Total	986.8	877.9	403.4	303.7	187.0	395.6	287.5

* 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 %	3.1 %	2.2 %	2.4 %
15-35	1.6 %	3.0 %	2.7 %	2.6 %
36-60	-	4.0 %	2.9 %	3.3 %
61-90	-	3.7 %	3.4 %	3.5 %
91-180	-	4.0 %	3.2 %	3.6 %
>180	-	4.0 %	3.5 %	3.8 %
Total	1.9 %	3.3 %	2.7 %	2.7 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	19	134	4091	4039	14	187	3092	3228	9	124	2322	2586
Intragruppo y off-shore***	0	0	2398	1593	0	0	1785	1235	0	0	1424	819
Otros	134	19	620	1477	186	14	695	1110	124	9	840	1181
Total	152	152	7108	7108	200	200	5572	5572	133	133	4587	4587

* 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.