

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 16 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\$1636.6 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	460.9	184.2	17.0	295.3	57.2	55.6	110.0
15-35	472.8	412.7	307.5	189.5	42.1	220.3	63.0
36-60	22.1	38.6	0.3	0.0	38.2	22.1	0.0
61-90	2.5	60.9	0.0	0.0	60.9	2.5	0.0
91-180	19.8	41.4	0.0	0.0	36.4	14.8	5.0
>180	24.3	88.5	6.0	0.0	68.5	10.3	14.0
Total	1002.3	826.2	330.9	484.7	303.4	325.6	192.0

* 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 %	3.1 %	2.0 %	2.2 %
15-35	2.7 %	3.1 %	3.2 %	3.1 %
36-60	-	3.9 %	2.8 %	3.5 %
61-90	-	3.8 %	2.8 %	3.8 %
91-180	3.4 %	4.0 %	3.2 %	3.7 %
>180	3.6 %	4.4 %	3.4 %	4.2 %
Total	2.4 %	3.5 %	2.7 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	18	133	4366	4089	15	188	3187	3320	9	126	2427	2646
Intragruppo y off-shore***	0	0	2409	1840	0	0	1796	1267	0	0	1424	844
Otros	133	18	633	1478	188	15	731	1127	126	9	861	1222
Total	151	151	7408	7408	203	203	5714	5714	135	135	4712	4712

* 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.