

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 17 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\$1162.3 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	227.4	170.3	25.0	66.0	17.3	33.4	128.0
15-35	397.6	192.6	118.5	123.0	51.1	251.6	23.0
36-60	3.5	11.6	0.0	0.0	11.6	3.5	0.0
61-90	54.8	45.9	12.8	30.0	23.2	14.8	10.0
91-180	45.7	129.6	60.1	0.0	59.5	35.7	10.0
>180	17.6	52.7	20.0	0.0	16.7	1.6	16.0
Total	746.6	602.7	236.4	219.0	179.3	340.6	187.0

* 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	2.5 %	4.3 %	2.4 %	2.8 %
15-35	3.0 %	3.1 %	2.2 %	2.5 %
36-60	-	4.0 %	2.8 %	3.7 %
61-90	2.9 %	3.7 %	3.0 %	3.3 %
91-180	3.4 %	3.6 %	3.4 %	3.6 %
>180	3.5 %	3.9 %	3.2 %	3.7 %
Total	2.7 %	3.6 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	131	4414	4118	16	189	3254	3373	9	126	2536	2745
Intragruppo y off-shore***	0	0	2412	1875	0	0	1818	1292	0	0	1430	850
Otros	131	18	639	1472	189	16	739	1146	126	9	868	1240
Total	149	149	7465	7465	205	205	5811	5811	136	136	4835	4835

* 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.