

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1335.2 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	256.6	105.3	55.0	155.0	40.3	91.6	10.0
15-35	372.3	555.3	305.5	97.8	52.8	77.5	197.0
36-60	5.2	12.2	0.0	0.4	9.6	2.2	2.6
61-90	33.1	37.0	0.0	20.0	24.0	0.1	13.0
91-180	66.5	104.7	60.5	0.0	17.2	39.5	27.0
>180	32.0	5.4	0.0	20.8	4.6	10.4	0.8
Total	765.7	819.9	421.0	294.0	148.5	221.3	250.4

* 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	1.8 %	3.1 %	2.6 %	2.7 %
15-35	2.5 %	2.8 %	2.4 %	2.6 %
36-60	2.8 %	3.3 %	1.9 %	3.0 %
61-90	3.0 %	3.5 %	2.9 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
>180	3.4 %	4.1 %	3.2 %	3.3 %
Total	2.5 %	3.0 %	2.6 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. 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**	18	131	4414	4118	17	193	3423	3421	9	124	2628	2806
Intragrupa y off-shore***	0	0	2412	1875	0	0	1840	1422	0	0	1463	875
Otros	131	18	639	1472	193	17	755	1174	124	9	897	1306
Total	149	149	7465	7465	211	211	6018	6018	134	134	4988	4988

* 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.