

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1277.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	390.9	328.2	150.0	157.3	18.2	73.7	160.0
15-35	139.4	399.8	275.8	19.5	51.0	46.9	73.0
36-60	7.4	7.8	0.0	0.0	7.8	7.4	0.0
61-90	2.5	5.9	0.0	0.0	5.9	2.5	0.0
91-180	161.6	65.7	0.0	0.0	25.7	121.6	40.0
>180	33.6	7.7	0.0	33.6	7.7	0.0	0.0
Total	735.4	815.1	425.8	210.4	116.3	252.0	273.0

* 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	1.5 %	2.8 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.5 %	2.4 %	1.9 %	2.3 %
36-60	-	3.9 %	2.2 %	3.1 %
61-90	-	3.4 %	2.7 %	3.2 %
91-180	3.3 %	1.6 %	2.8 %	2.7 %
>180	-	3.6 %	2.9 %	3.6 %
Total	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.2 %

*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	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	195	3694	3601	9	125	2692	2940	15	108	2439	2939
Intragruppo y off-shore***	0	0	1859	1541	0	0	1594	914	0	0	1949	687
Otros	195	17	771	1182	125	9	900	1332	108	15	544	1305
Total	212	212	6324	6324	134	134	5186	5186	123	123	4931	4931

* 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.