

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 23 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\$1477.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	361.4	264.4	95.0	174.5	42.0	59.5	127.4
15-35	336.7	546.3	388.0	52.5	32.9	158.8	125.4
36-60	13.2	21.8	0.0	0.0	11.8	3.2	10.0
61-90	33.4	5.9	0.0	1.0	4.1	30.7	1.8
91-180	82.3	9.4	5.0	0.0	4.4	82.3	0.0
>180	50.4	36.2	10.6	20.0	5.6	10.4	20.0
Total	877.6	884.1	498.6	248.0	100.9	345.0	284.6

* 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	2.3 %	2.9 %	1.2 %	2.0 %
15-35	2.9 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
36-60	3.1 %	1.3 %	2.4 %	2.2 %
61-90	3.2 %	3.9 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.7 %	3.0 %	3.1 %
>180	3.4 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
Total	2.6 %	2.8 %	2.2 %	2.5 %

*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	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**	18	191	3973	3706	17	120	2887	3175	16	109	2755	3179
Intragrupa y off-shore***	0	0	1898	1752	0	0	1698	977	0	0	2008	710
Otros	191	18	783	1196	120	17	933	1366	109	16	555	1428
Total	208	208	6654	6654	137	137	5518	5518	125	125	5317	5317

* 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.