

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 24 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\$1371.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	255.2	160.2	32.0	148.0	68.2	47.2	60.0
15-35	365.6	378.1	278.6	103.0	52.0	215.2	47.5
36-60	59.8	95.5	20.0	0.0	33.5	17.8	42.0
61-90	27.5	29.1	20.0	20.0	9.1	7.5	0.0
91-180	19.4	88.5	0.0	0.0	88.5	19.4	0.0
>180	22.1	25.2	15.0	10.0	5.2	7.1	5.0
Total	749.6	776.6	365.6	281.0	256.5	314.1	154.5

* 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 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
15-35	3.3 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
36-60	3.5 %	3.6 %	2.7 %	3.4 %
61-90	-	3.6 %	3.1 %	3.4 %
91-180	-	4.0 %	3.4 %	3.9 %
>180	3.5 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
Total	3.1 %	3.4 %	2.9 %	3.1 %

*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	189	3987	3727	19	119	2989	3243	16	108	2902	3287
Intragruppo y off-shore***	0	0	1898	1762	0	0	1698	1044	0	0	2060	791
Otros	189	17	803	1199	119	19	981	1381	108	16	571	1454
Total	206	206	6688	6688	137	137	5669	5669	125	125	5533	5533

* 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.