

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 25 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\$1162.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	291.0	108.7	36.0	169.3	27.7	76.8	45.0
15-35	318.7	457.0	320.3	147.8	66.8	100.9	70.0
36-60	2.8	3.1	0.0	0.0	3.1	2.8	0.0
61-90	14.4	37.1	30.0	0.0	7.1	14.4	0.0
91-180	10.2	25.7	0.0	0.0	15.7	0.2	10.0
>180	2.4	16.6	0.0	0.0	16.6	2.4	0.0
Total	639.6	648.2	386.3	317.1	136.9	197.5	125.0

* 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	1.7 %	2.1 %	2.6 %	2.3 %
15-35	2.9 %	2.0 %	2.9 %	2.4 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.6 %
61-90	-	3.6 %	3.1 %	3.5 %
91-180	3.7 %	3.9 %	4.9 %	3.8 %
>180	-	4.0 %	3.8 %	4.0 %
Total	2.5 %	2.3 %	2.8 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	185	3987	3728	20	119	3202	3328	17	110	2979	3309
Intragrupoy off-shore***	0	0	1898	1762	0	0	1716	1173	0	0	2078	831
Otros	185	17	804	1199	119	20	1002	1420	110	17	575	1491
Total	202	202	6689	6689	139	139	5921	5921	127	127	5631	5631

* 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.