

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 28 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\$1348.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	409.0	200.7	51.0	225.8	20.4	54.0	129.3
15-35	263.0	366.3	260.5	42.7	64.8	179.2	41.0
36-60	129.1	38.3	0.0	10.0	38.3	119.1	0.0
61-90	1.7	6.7	0.0	0.3	6.7	1.5	0.0
91-180	65.5	26.0	0.0	0.3	26.0	65.2	0.0
>180	6.7	11.9	0.0	0.0	5.9	0.7	6.0
Total	874.8	649.9	311.5	279.0	162.1	419.6	176.3

* 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	2.7 %	3.0 %	1.1 %	1.9 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.1 %	3.3 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.4 %
61-90	-	3.9 %	3.4 %	3.8 %
91-180	-	4.1 %	3.3 %	3.6 %
>180	4.0 %	4.0 %	2.9 %	4.0 %
Total	2.9 %	3.5 %	2.4 %	2.8 %

*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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	124	3426	3396	24	110	3148	3442	25	140	2149	2399
Intragruppo y off-shore***	0	0	1752	1357	0	0	2093	873	0	1	1451	414
Otros	124	21	1005	1431	110	24	593	1518	140	24	613	1400
Total	145	145	6184	6184	135	135	5834	5834	165	165	4213	4213

* 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.