

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 07 de septiembre de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$72.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34.1	20.9	2.0	2.0	3.9	17.1	15.0
15-35	3.2	12.3	9.0	0.0	3.3	3.2	0.0
36-60	0.6	3.2	0.0	0.0	3.2	0.6	0.0
61-90	1.2	1.5	0.0	0.0	1.5	1.2	0.0
91-180	2.0	2.1	0.0	0.0	2.1	2.0	0.0
>180	4.8	2.0	0.0	0.0	2.0	4.8	0.0
Total	45.8	42.0	11.0	2.0	16.0	28.8	15.0

* 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	
3-14	3.0 %	1.8 %	1.1 %	1.9 %
15-35	-	2.3 %	1.8 %	2.2 %
36-60	-	3.2 %	2.5 %	3.1 %
61-90	-	3.9 %	2.3 %	3.2 %
91-180	-	3.8 %	3.1 %	3.5 %
>180	-	3.9 %	1.1 %	1.9 %
Total	3.0 %	2.6 %	1.4 %	2.2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards**

Sectores	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	104	3216	2815	20	134	3102	3241	13	179	2392	2632
Intragrupo y off-shore***	0	0	1700	1090	0	0	1926	972	0	0	1563	1014
Otros	104	32	596	1607	134	20	564	1378	179	13	604	913
Total	137	137	5513	5513	154	154	5592	5592	192	192	4559	4559

* 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.

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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.