

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2015

Fecha de Información: 01 de octubre 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\$1858.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	377.7	213.5	114.7	294.7	68.8	53.0	30.0
15-35	471.1	528.4	384.8	193.1	92.6	227.0	51.0
36-60	1.0	66.7	0.2	0.0	66.5	1.0	0.0
61-90	4.0	31.6	26.5	3.5	5.1	0.5	0.0
91-180	106.2	14.7	0.1	0.0	14.6	106.2	0.0
>180	53.4	114.5	40.1	10.0	31.4	0.4	43.0
Total	1013.4	969.4	566.3	501.3	279.0	388.2	124.0

* 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	4.2 %	4.3 %	4.1 %	4.2 %
15-35	4.3 %	5.3 %	4.4 %	4.8 %
36-60	-	4.9 %	4.0 %	4.9 %
61-90	-	4.8 %	4.4 %	4.8 %
91-180	-	5.2 %	4.4 %	4.5 %
>180	4.7 %	4.8 %	4.2 %	4.8 %
Total	4.4 %	5.0 %	4.3 %	4.6 %

*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	128	4039	3609	26	112	3606	3762	25	144	2501	2632
Intragruppo y off-shore***	0	0	1856	1853	0	0	2244	1189	0	1	1487	496
Otros	128	21	1049	1482	112	26	710	1609	144	24	694	1555
Total	149	149	6944	6944	138	138	6559	6559	169	169	4682	4682

* 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.