

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2015

Fecha de Información: 02 de octubre 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\$1253.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	478.0	342.9	115.2	266.0	72.7	57.0	155.0
15-35	168.7	290.5	228.8	86.0	25.1	46.2	36.5
36-60	26.1	87.5	25.0	0.0	37.5	1.1	25.0
61-90	18.6	21.7	0.9	0.0	20.8	18.6	0.0
91-180	16.8	10.0	0.0	0.0	10.0	16.8	0.0
>180	3.1	6.5	0.0	0.0	6.5	3.1	0.0
Total	711.1	759.0	369.9	352.0	172.6	142.6	216.5

* 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	4.1 %	4.6 %	3.7 %	4.0 %
15-35	4.3 %	4.5 %	4.0 %	4.3 %
36-60	4.2 %	4.9 %	2.3 %	4.6 %
61-90	-	4.7 %	4.1 %	4.4 %
91-180	-	5.0 %	4.3 %	4.6 %
>180	-	5.0 %	3.9 %	4.6 %
Total	4.2 %	4.6 %	3.8 %	4.2 %

*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	127	4040	3609	31	114	3975	3927	23	145	2595	2806
Intragruppo y off-shore***	0	0	1856	1853	0	0	2292	1429	0	1	1555	522
Otros	127	21	1049	1483	114	31	722	1632	145	22	751	1573
Total	148	148	6945	6945	145	145	6988	6988	168	168	4901	4901

* 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.