

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2015

Fecha de Información: 05 de octubre 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\$1245.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	227.2	209.8	63.0	88.5	65.3	57.2	81.5
15-35	493.0	198.6	20.0	267.8	82.1	128.7	96.5
36-60	41.1	70.3	20.0	0.0	50.3	41.1	0.0
61-90	12.0	26.7	0.0	0.0	26.7	12.0	0.0
91-180	2.3	58.2	0.0	0.0	58.2	2.3	0.0
>180	52.8	81.5	0.0	0.0	31.5	2.8	50.0
Total	828.4	645.1	103.0	356.3	314.1	244.1	228.0

* 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 %	4.2 %	3.4 %	3.9 %
15-35	0.0 %	4.7 %	4.0 %	3.4 %
36-60	-	3.9 %	3.9 %	3.9 %
61-90	-	4.8 %	4.0 %	4.6 %
91-180	-	4.8 %	4.1 %	4.8 %
>180	4.5 %	4.9 %	4.1 %	4.6 %
Total	2.5 %	4.5 %	3.9 %	3.8 %

*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	5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	118	4078	4051	22	150	2705	2868	10	193	2517	2708
Intragruppo y off-shore***	0	0	2341	1454	0	1	1559	580	0	0	1725	633
Otros	118	35	729	1644	150	22	801	1615	193	10	465	1366
Total	153	153	7148	7148	173	173	5064	5064	203	203	4707	4707

* 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.