

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2015

Fecha de Información: 06 de octubre de martes 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\$2201.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	541.1	226.1	69.6	367.0	77.5	95.1	79.0
15-35	837.6	573.7	239.3	275.1	60.5	288.6	273.9
36-60	5.3	64.0	0.0	0.0	63.0	4.3	1.0
61-90	12.9	26.4	0.0	0.0	26.4	12.9	0.0
91-180	50.8	128.1	10.0	0.0	118.1	50.8	0.0
>180	51.8	87.6	0.1	0.0	37.6	1.8	50.0
Total	1499.5	1106.0	319.0	642.1	383.1	453.5	403.9

* 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	1.9 %	3.7 %	2.9 %	2.9 %
15-35	2.9 %	3.9 %	3.6 %	3.5 %
36-60	4.0 %	4.5 %	3.6 %	4.5 %
61-90	-	4.8 %	4.0 %	4.5 %
91-180	-	4.7 %	4.1 %	4.5 %
>180	4.6 %	4.8 %	4.2 %	4.7 %
Total	3.0 %	4.2 %	3.4 %	3.5 %

*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	4338	4136	23	153	2911	2933	10	194	2704	2796
Intragruppo y off-shore***	0	0	2352	1637	0	1	1569	695	0	0	1788	787
Otros	118	35	755	1672	153	22	827	1679	194	10	477	1386
Total	153	153	7445	7445	175	175	5307	5307	204	204	4969	4969

* 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.