

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2015

Fecha de Información: 07 de octubre de miércoles 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\$2208.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	597.6	210.2	148.0	528.2	37.7	44.9	24.5
15-35	522.2	612.7	485.8	202.9	61.0	253.3	66.0
36-60	9.1	80.4	1.5	7.2	78.9	1.8	0.0
61-90	3.2	17.5	0.0	0.0	17.5	3.2	0.0
91-180	100.2	41.7	0.0	0.2	41.7	99.9	0.0
>180	66.3	81.0	0.0	15.0	38.0	8.3	43.0
Total	1298.5	1043.5	635.3	753.6	274.8	411.4	133.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.6 %	1.7 %	2.6 %	2.3 %
15-35	3.1 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	4.2 %	3.2 %	4.2 %
61-90	-	4.6 %	2.5 %	4.3 %
91-180	-	4.7 %	4.0 %	4.2 %
>180	4.7 %	4.9 %	4.5 %	4.7 %
Total	3.5 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %

*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 intragruppo.

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	121	4757	4160	23	151	2995	3039	10	200	2886	2910
Intragrupoy off-shore***	0	0	2361	2032	0	1	1651	751	0	0	1865	914
Otros	121	35	761	1688	151	22	852	1707	200	10	484	1411
Total	156	156	7879	7879	174	174	5497	5497	210	210	5235	5235

* 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.