

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2015

Fecha de Información: 08 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\$1634.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	525.2	309.3	72.0	304.8	68.3	51.4	169.0
15-35	297.9	355.6	222.3	108.5	110.3	166.4	23.0
36-60	36.9	46.6	0.0	0.0	46.6	36.9	0.0
61-90	7.6	43.6	0.0	6.0	43.6	1.5	0.0
91-180	58.0	63.9	0.0	0.0	63.9	58.0	0.0
>180	62.0	49.6	0.0	0.0	19.6	32.0	30.0
Total	987.5	868.6	294.3	419.3	352.3	346.2	222.0

* 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	2.6 %	3.1 %	2.3 %	2.5 %
15-35	3.3 %	3.7 %	3.2 %	3.5 %
36-60	-	4.4 %	3.0 %	3.8 %
61-90	4.2 %	4.7 %	2.8 %	4.6 %
91-180	-	4.8 %	4.2 %	4.5 %
>180	4.7 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
Total	3.0 %	3.8 %	2.9 %	3.3 %

*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	4906	4167	22	154	3272	3169	11	208	2989	3049
Intragruppo y off-shore***	0	0	2361	2175	0	1	1677	903	0	0	1911	923
Otros	118	35	768	1693	154	21	869	1746	208	11	495	1423
Total	152	152	8035	8035	176	176	5818	5818	219	219	5395	5395

* 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.