

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2015

Fecha de Información: 13 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\$1662.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	449.6	230.5	93.5	308.0	35.9	40.6	101.0
15-35	418.6	462.5	384.0	175.0	36.5	201.6	42.0
36-60	3.8	31.9	0.0	0.0	30.9	2.8	1.0
61-90	2.9	8.3	0.0	0.0	8.3	2.9	0.0
91-180	15.0	177.2	31.6	0.0	145.6	15.0	0.0
>180	2.6	3.3	0.0	0.0	3.3	2.6	0.0
Total	892.5	913.6	509.1	483.0	260.5	265.5	144.0

* 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	4.0 %	3.6 %	-1.2 %	1.0 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
36-60	3.4 %	3.5 %	2.7 %	3.5 %
61-90	-	4.3 %	3.4 %	4.1 %
91-180	-	4.7 %	4.3 %	4.6 %
>180	-	5.1 %	4.2 %	4.7 %
Total	3.8 %	3.7 %	1.1 %	2.6 %

*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	12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	157	3789	3486	15	214	3239	3227	25	115	2567	3029
Intragruppo y off-shore***	0	1	1800	1203	0	0	2021	1102	0	0	1614	806
Otros	157	26	888	1788	214	15	536	1467	115	25	772	1119
Total	184	184	6477	6477	229	229	5796	5796	140	140	4954	4954

* 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.