

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2015

Fecha de Información: 14 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\$1977.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	456.6	293.0	77.0	313.3	128.2	55.5	87.9
15-35	603.7	664.3	414.3	125.0	81.1	309.7	169.0
36-60	14.6	28.3	7.0	0.0	21.3	14.6	0.0
61-90	0.9	9.4	0.0	0.0	9.4	0.9	0.0
91-180	64.7	82.2	0.0	0.0	82.2	64.7	0.0
>180	0.4	16.3	10.0	0.0	6.3	0.4	0.0
Total	1140.7	1093.5	508.3	438.3	328.4	445.6	256.9

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.7 %	4.0 %	-1.1 %	1.5 %
15-35	3.6 %	4.0 %	3.4 %	3.7 %
36-60	-	4.3 %	3.5 %	4.0 %
61-90	-	5.3 %	4.0 %	5.2 %
91-180	-	5.0 %	4.4 %	4.7 %
>180	-	4.6 %	4.7 %	4.6 %
Total	4.3 %	4.2 %	1.7 %	3.1 %

*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	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	140	4014	3518	17	213	3380	3423	25	114	2681	3133
Intragruppo y off-shore***	0	1	1800	1404	0	0	2074	1171	0	0	1662	864
Otros	140	26	902	1794	212	17	632	1492	114	25	797	1143
Total	167	167	6716	6716	229	229	6086	6086	139	139	5140	5140

* 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.