

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2015

Fecha de Información: 16 de octubre de viernes 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\$958.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	173.5	169.3	42.7	21.5	13.6	39.0	113.0
15-35	311.8	342.2	179.8	63.0	32.4	118.8	130.0
36-60	8.3	10.7	1.0	0.0	8.7	7.3	1.0
61-90	13.0	19.2	0.0	0.0	19.2	13.0	0.0
91-180	41.1	51.5	30.0	36.2	21.5	4.9	0.0
>180	42.8	51.1	0.1	5.8	19.0	5.0	32.0
Total	590.6	644.1	253.6	126.5	114.5	188.1	276.0

* 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	3.7 %	4.6 %	3.6 %	3.9 %
15-35	4.4 %	4.5 %	4.3 %	4.4 %
36-60	4.5 %	5.4 %	4.0 %	4.8 %
61-90	-	5.0 %	4.3 %	4.7 %
91-180	-	5.0 %	4.6 %	4.9 %
>180	5.0 %	5.0 %	4.6 %	4.9 %
Total	4.2 %	4.7 %	4.2 %	4.4 %

*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	130	4040	3526	17	220	3584	3661	25	116	2799	3210
Intragruppo y off-shore***	0	1	1800	1424	0	0	2177	1220	0	0	1686	881
Otros	130	26	910	1800	220	17	662	1542	116	25	821	1216
Total	157	157	6749	6749	237	237	6423	6423	141	141	5307	5307

* 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.