

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2015

Fecha de Información: 20 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\$1707.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	379.2	271.4	57.5	163.0	23.9	26.2	190.0
15-35	650.4	610.8	245.1	236.0	50.8	99.4	315.0
36-60	10.0	20.0	0.0	2.5	20.0	7.5	0.0
61-90	0.3	1.8	0.0	0.0	1.8	0.3	0.0
91-180	39.8	131.5	60.0	0.0	71.5	39.8	0.0
>180	70.0	77.6	20.0	20.0	7.6	0.0	50.0
Total	1149.7	1113.1	382.6	421.5	175.6	173.2	555.0

* 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	3.1 %	4.6 %	3.5 %	3.5 %
15-35	4.2 %	4.6 %	4.2 %	4.3 %
36-60	-	4.9 %	4.4 %	4.7 %
61-90	-	5.3 %	4.4 %	5.2 %
91-180	-	5.1 %	4.5 %	4.9 %
>180	5.0 %	5.0 %	4.9 %	5.0 %
Total	3.9 %	4.8 %	4.1 %	4.2 %

*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 intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	198	3989	3986	26	115	2978	3388	8	137	2604	2570
Intragruppo y off-shore***	0	0	2311	1446	0	0	1728	906	0	0	1568	842
Otros	198	17	681	1550	115	26	845	1257	137	8	366	1126
Total	215	215	6981	6981	141	141	5551	5551	144	144	4538	4538

* 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.