

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1848.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	447.9	242.8	79.4	253.8	8.4	39.1	155.0
15-35	531.1	720.7	480.4	149.0	38.8	180.6	201.5
36-60	26.9	8.6	0.1	8.0	6.2	16.6	2.3
61-90	2.9	19.1	17.2	0.0	1.9	2.9	0.0
91-180	37.7	119.9	30.5	20.0	79.4	7.7	10.0
>180	52.5	27.5	3.6	21.9	3.9	10.6	20.0
Total	1099.0	1138.5	611.2	452.7	138.5	257.5	388.8

* 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	5.0 %	3.2 %	3.9 %	4.2 %
15-35	4.6 %	5.1 %	4.9 %	4.9 %
36-60	4.7 %	5.2 %	4.6 %	4.7 %
61-90	-	4.9 %	4.4 %	4.9 %
91-180	4.9 %	5.1 %	4.5 %	5.1 %
>180	4.9 %	5.2 %	4.9 %	4.9 %
Total	4.8 %	4.9 %	4.5 %	4.7 %

*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	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	4209	4113	32	114	3118	3445	8	138	2708	2678
Intragruppo y off-shore***	0	0	2351	1578	0	0	1767	1007	0	0	1597	867
Otros	198	17	683	1553	114	32	853	1287	138	8	366	1126
Total	215	215	7244	7244	146	146	5738	5738	145	145	4671	4671

* 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.