

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2015

Fecha de Información: 22 de octubre de jueves 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\$1863.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	163.7	139.2	72.0	120.5	38.8	14.8	28.4
15-35	783.1	724.2	342.5	184.5	36.2	253.1	345.5
36-60	26.5	45.6	7.0	0.0	18.6	6.5	20.0
61-90	74.7	64.6	25.0	20.0	14.6	29.7	25.0
91-180	87.8	126.6	10.0	10.0	66.6	27.8	50.0
>180	65.7	65.6	0.4	30.0	30.2	0.7	35.0
Total	1201.5	1165.7	456.9	365.0	204.9	332.7	503.9

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	4.1 %	3.5 %	3.9 %
15-35	3.6 %	4.2 %	4.2 %	4.0 %
36-60	4.7 %	4.5 %	4.3 %	4.6 %
61-90	5.0 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %
91-180	4.9 %	5.2 %	4.6 %	5.0 %
>180	5.0 %	5.2 %	4.9 %	5.1 %
Total	4.0 %	4.5 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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	4222	4118	35	118	3170	3515	8	139	2824	2762
Intragruppo y off-shore***	0	0	2352	1584	0	0	1813	1051	0	0	1622	938
Otros	198	17	684	1557	118	35	875	1293	139	8	382	1127
Total	215	215	7259	7259	153	153	5859	5859	147	147	4827	4827

* 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.