

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2015

Fecha de Información: 26 de octubre de lunes 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\$1090.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	217.2	232.0	99.0	76.5	23.0	30.7	110.0
15-35	434.9	239.4	53.8	266.5	120.1	102.9	65.5
36-60	20.4	38.3	0.0	1.8	23.3	3.7	15.0
61-90	10.3	19.2	0.0	0.0	19.2	10.3	0.0
91-180	12.3	29.5	10.0	0.0	19.5	12.3	0.0
>180	12.1	15.3	0.0	10.4	15.3	1.7	0.0
Total	707.2	573.6	162.8	355.1	220.3	161.6	190.5

* 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	4.4 %	3.9 %	4.2 %	4.2 %
15-35	4.3 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %
36-60	4.0 %	5.2 %	4.6 %	4.7 %
61-90	-	5.3 %	4.8 %	5.1 %
91-180	-	5.2 %	4.9 %	5.1 %
>180	-	5.6 %	4.9 %	5.5 %
Total	4.3 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	122	3482	3816	8	143	2934	2847	9	141	2114	2424
Intragrupa y off-shore***	0	0	1952	1178	0	0	1673	1013	0	0	1454	573
Otros	122	37	889	1329	143	8	394	1142	141	9	495	1066
Total	158	158	6323	6323	151	151	5002	5002	150	150	4063	4063

* 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.

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.