

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2015

Fecha de Información: 27 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\$1163.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	282.5	175.0	71.6	147.6	13.4	45.0	90.0
15-35	245.9	369.3	254.9	67.1	17.8	82.2	96.6
36-60	34.3	7.5	0.0	9.6	7.5	24.7	0.0
61-90	31.0	11.1	0.0	0.0	11.1	31.0	0.0
91-180	39.6	38.4	0.0	20.0	38.4	19.6	0.0
>180	72.9	62.5	20.0	40.0	22.5	12.9	20.0
Total	706.2	663.8	346.5	284.3	110.7	215.3	206.6

* 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	4.8 %	4.7 %	2.9 %	3.8 %
15-35	4.6 %	4.8 %	4.4 %	4.6 %
36-60	-	5.0 %	4.5 %	4.6 %
61-90	-	6.0 %	4.6 %	5.0 %
91-180	-	5.3 %	4.8 %	5.0 %
>180	5.0 %	5.1 %	4.9 %	5.0 %
Total	4.7 %	4.9 %	3.9 %	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	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**	40	143	3674	3884	10	143	2971	2904	9	141	2164	2470
Intragruppo y off-shore***	0	0	1983	1302	0	0	1714	1027	0	0	1464	583
Otros	143	40	890	1362	143	10	390	1145	141	9	496	1071
Total	184	184	6547	6547	153	153	5075	5075	150	150	4124	4124

* 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.