

Fecha de Publicación: 3 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1590.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	305.3	166.2	79.0	184.3	44.3	78.1	42.9
15-35	605.8	370.2	229.0	237.5	43.9	271.0	97.3
36-60	41.6	12.0	0.0	0.0	10.3	40.0	1.6
61-90	10.3	33.5	20.0	0.0	3.5	0.3	10.0
91-180	20.2	75.6	55.0	20.0	20.6	0.2	0.0
>180	70.0	51.9	20.0	40.0	11.9	10.0	20.0
Total	1053.2	709.4	403.0	481.8	134.5	399.6	171.9

* 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	4.0 %	4.4 %	4.1 %	4.2 %
15-35	4.3 %	4.5 %	4.5 %	4.5 %
36-60	4.3 %	5.3 %	4.7 %	4.8 %
61-90	4.7 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %
91-180	-	5.0 %	4.8 %	4.9 %
>180	5.0 %	5.1 %	4.9 %	5.0 %
Total	4.3 %	4.6 %	4.5 %	4.5 %

*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**	32	154	4081	3916	15	144	3138	2953	15	137	2297	2699
Intragruppo y off-shore***	0	0	1986	1661	0	0	1731	1150	0	0	1626	600
Otros	154	32	897	1388	144	15	401	1168	137	15	532	1157
Total	186	186	6965	6965	159	159	5270	5270	153	153	4456	4456

* 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.