

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2015

Fecha de Información: 29 de septiembre 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\$1557.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	405.5	250.3	99.0	237.5	61.3	78.0	90.0
15-35	444.4	415.0	271.5	91.0	59.0	268.9	84.5
36-60	12.0	14.3	0.0	10.0	14.3	2.0	0.0
61-90	3.9	7.8	0.0	0.0	7.8	3.9	0.0
91-180	39.2	24.6	0.0	15.0	4.6	4.2	20.0
>180	103.2	75.6	0.0	35.0	31.3	23.9	44.3
Total	1008.3	787.6	370.5	388.5	178.3	381.0	238.8

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.6 %	3.9 %	1.8 %	2.5 %
15-35	2.9 %	3.9 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.9 %	3.4 %	3.6 %
61-90	-	4.1 %	2.8 %	3.7 %
91-180	4.5 %	4.4 %	4.0 %	4.3 %
>180	4.3 %	4.8 %	4.3 %	4.4 %
Total	3.2 %	4.0 %	2.8 %	3.3 %

*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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	127	3721	3538	26	112	3234	3526	26	142	2271	2454
Intragruppo y off-shore***	0	0	1809	1561	0	0	2135	906	0	1	1451	419
Otros	127	21	1044	1476	112	26	610	1547	142	25	628	1478
Total	148	148	6574	6574	138	138	5979	5979	168	168	4351	4351

* 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.