

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2015

Fecha de Información: 30 de septiembre de miércoles 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\$1825.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	542.8	250.3	56.1	356.0	101.3	93.9	93.0
15-35	413.3	520.3	316.5	222.6	69.8	56.7	134.0
36-60	19.5	25.4	0.0	0.0	25.4	19.5	0.0
61-90	15.7	21.0	10.0	0.0	11.0	15.7	0.0
91-180	1.9	10.8	0.0	0.0	10.8	1.9	0.0
>180	130.3	194.0	95.0	35.0	5.5	1.8	93.5
Total	1123.6	1021.9	477.6	613.5	223.8	189.6	320.5

* 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	3.3 %	3.7 %	3.0 %	3.2 %
15-35	4.6 %	4.8 %	4.0 %	4.6 %
36-60	-	4.7 %	4.1 %	4.5 %
61-90	-	4.7 %	4.0 %	4.3 %
91-180	-	4.8 %	3.8 %	4.7 %
>180	4.6 %	4.6 %	4.7 %	4.6 %
Total	4.2 %	4.5 %	3.5 %	4.0 %

*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	3984	3587	26	113	3404	3677	25	143	2380	2505
Intragruppo y off-shore***	0	0	1835	1800	0	0	2165	992	0	1	1451	451
Otros	127	21	1047	1480	113	26	703	1603	143	24	634	1509
Total	148	148	6866	6866	138	138	6272	6272	168	168	4465	4465

* 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.