Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2015

Fecha de Información: 23 de octubre de viernes [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$1018.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	215.8	197.4	91.5	124.9	45.9	30.9	60.0
15-35	196.3	307.1	241.5	57.4	25.6	98.9	40.0
36-60	27.4	34.8	15.0	0.8	4.8	11.6	15.0
61-90	1.6	18.4	15.0	0.0	3.4	1.6	0.0
91-180	47.7	61.9	53.9	30.0	8.0	17.7	0.0
>180	20.4	14.8	0.0	10.0	4.8	0.4	10.0
Total	**509.2**	**634.4**	**416.9**	**223.1**	**92.5**	**161.1**	**125.0**

* 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	5.6 %	4.5 %	4.3 %	4.6 %
15-35	1.3 %	3.8 %	4.4 %	3.8 %
36-60	3.7 %	4.0 %	4.5 %	4.0 %
61-90	-	5.3 %	4.6 %	5.2 %
91-180	-	5.0 %	4.8 %	5.0 %
>180	5.1 %	5.3 %	4.7 %	5.2 %
Total	3.9 %	4.3 %	4.4 %	4.3 %

*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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	196	4223	4118	36	122	3375	3691	8	139	2832	2779
Intragrupo y off-shore***	0	0	2352	1584	0	0	1892	1176	0	0	1635	938
Otros	196	16	684	1558	122	36	913	1313	139	8	385	1136
Total	**213**	**213**	**7260**	**7260**	**158**	**158**	**6180**	**6180**	**147**	**147**	**4852**	**4852**

* 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.