

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2015

Fecha de Información: 26 de octubre de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1090.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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 | 217.2 | 232.0 | 99.0 | 76.5 | 23.0 | 30.7 | 110.0 |
| 15-35 | 434.9 | 239.4 | 53.8 | 266.5 | 120.1 | 102.9 | 65.5 |
| 36-60 | 20.4 | 38.3 | 0.0 | 1.8 | 23.3 | 3.7 | 15.0 |
| 61-90 | 10.3 | 19.2 | 0.0 | 0.0 | 19.2 | 10.3 | 0.0 |
| 91-180 | 12.3 | 29.5 | 10.0 | 0.0 | 19.5 | 12.3 | 0.0 |
| >180 | 12.1 | 15.3 | 0.0 | 10.4 | 15.3 | 1.7 | 0.0 |
| Total | 707.2 | 573.6 | 162.8 | 355.1 | 220.3 | 161.6 | 190.5 |

* 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 | |
| 3-14 | 4.4 % | 3.9 % | 4.2 % | 4.2 % |
| 15-35 | 4.3 % | 4.8 % | 4.5 % | 4.6 % |
| 36-60 | 4.0 % | 5.2 % | 4.6 % | 4.7 % |
| 61-90 | - | 5.3 % | 4.8 % | 5.1 % |
| 91-180 | - | 5.2 % | 4.9 % | 5.1 % |
| >180 | - | 5.6 % | 4.9 % | 5.5 % |
| Total | 4.3 % | 4.6 % | 4.4 % | 4.5 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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** | 37 | 122 | 3482 | 3816 | 8 | 143 | 2934 | 2847 | 9 | 141 | 2114 | 2424 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1952 | 1178 | 0 | 0 | 1673 | 1013 | 0 | 0 | 1454 | 573 |
| Otros | 122 | 37 | 889 | 1329 | 143 | 8 | 394 | 1142 | 141 | 9 | 495 | 1066 |
| Total | 158 | 158 | 6323 | 6323 | 151 | 151 | 5002 | 5002 | 150 | 150 | 4063 | 4063 |

* 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.

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.