

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2015

Fecha de Información: 28 de octubre 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\$1497.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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 | 395.9 | 51.3 | 13.1 | 315.1 | 8.2 | 50.8 | 30.0 |
| 15-35 | 397.3 | 493.2 | 409.5 | 162.8 | 48.7 | 199.5 | 35.0 |
| 36-60 | 40.5 | 36.2 | 0.0 | 0.0 | 36.2 | 40.5 | 0.0 |
| 61-90 | 12.4 | 17.2 | 0.0 | 0.0 | 15.2 | 10.4 | 2.0 |
| 91-180 | 77.3 | 28.1 | 10.0 | 0.0 | 18.1 | 77.3 | 0.0 |
| >180 | 0.0 | 15.2 | 0.0 | 0.0 | 15.2 | 0.0 | 0.0 |
| Total | 923.5 | 641.2 | 432.6 | 477.9 | 141.6 | 378.6 | 67.0 |

* 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 | 4.5 % | 5.1 % | 5.7 % | 5.6 % |
| 15-35 | 4.7 % | 5.2 % | 4.8 % | 5.0 % |
| 36-60 | - | 5.1 % | 4.7 % | 4.9 % |
| 61-90 | 4.8 % | 5.3 % | 4.7 % | 5.0 % |
| 91-180 | - | 5.3 % | 4.7 % | 4.9 % |
| >180 | - | 5.3 % | - | 5.3 % |
| Total | 4.6 % | 5.2 % | 5.1 % | 5.1 % |

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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** | 41 | 148 | 4003 | 3902 | 14 | 142 | 3002 | 2916 | 16 | 139 | 2195 | 2528 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1986 | 1596 | 0 | 0 | 1724 | 1046 | 0 | 0 | 1497 | 585 |
| Otros | 148 | 41 | 885 | 1377 | 142 | 14 | 392 | 1156 | 139 | 16 | 511 | 1090 |
| Total | 189 | 189 | 6874 | 6874 | 157 | 157 | 5118 | 5118 | 154 | 154 | 4204 | 4204 |

* 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.