

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2015

Fecha de Información: 28 de octubre de miércoles¹

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**		Intragrupo 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	
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: ((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	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
Intragrupo 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.