

Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 30 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\$1237.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	193.1	147.8	95.1	148.8	47.7	39.3	5.0
15-35	453.9	287.0	146.7	262.0	79.3	131.0	61.0
36-60	35.3	41.2	0.0	10.0	26.2	10.3	15.0
61-90	4.2	28.2	0.0	0.0	28.2	4.2	0.0
91-180	11.6	46.4	0.1	0.0	36.3	1.6	10.0
>180	15.5	64.3	0.0	15.0	64.3	0.5	0.0
Total	713.6	614.8	241.8	435.7	282.0	186.9	91.0

* 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	3.7 %	5.0 %	3.9 %	4.4 %
15-35	4.1 %	4.6 %	4.2 %	4.4 %
36-60	4.7 %	5.2 %	4.6 %	4.9 %
61-90	-	5.1 %	4.4 %	5.0 %
91-180	4.8 %	5.4 %	4.5 %	5.2 %
>180	-	5.2 %	4.9 %	5.1 %
Total	4.2 %	4.9 %	4.2 %	4.5 %

*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	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**	32	157	4081	3914	16	154	3294	3062	15	140	2335	2728
Intragruppo y off-shore***	0	0	1986	1661	0	0	1823	1275	0	0	1629	624
Otros	157	32	895	1388	154	16	418	1199	140	15	554	1166
Total	189	189	6962	6962	170	170	5535	5535	155	155	4519	4519

* 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.