

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2016

Fecha de Información: 05 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\$2091.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	483.4	242.5	134.5	287.0	34.4	122.7	73.7
15-35	601.7	585.4	390.5	316.5	80.7	171.0	114.2
36-60	18.6	27.4	25.0	4.6	2.4	14.0	0.0
61-90	25.5	43.5	10.1	0.1	33.4	25.4	0.0
91-180	37.5	73.3	32.2	0.0	41.1	37.5	0.0
>180	56.2	84.0	80.0	50.0	4.0	6.2	0.0
Total	1222.9	1056.1	672.2	658.3	196.1	376.8	187.9

* 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	7.5 %	7.4 %	6.9 %	7.1 %
15-35	7.5 %	8.0 %	8.1 %	8.0 %
36-60	-	7.5 %	6.3 %	6.5 %
61-90	-	6.7 %	5.7 %	6.3 %
91-180	-	6.1 %	5.8 %	6.0 %
>180	-	6.0 %	5.9 %	5.9 %
Total	7.5 %	7.4 %	7.3 %	7.4 %

*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	3 al 7 de octubre				10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	128	4902	3984	21	151	3471	3024	16	96	2227	1860
Intragruppo y off-shore***	0	0	1999	1837	0	0	1366	1260	0	0	779	768
Otros	128	27	730	1804	151	21	872	1426	96	16	601	981
Total	155	155	7632	7626	172	172	5710	5710	113	113	3608	3608

* 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.