

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2016

Fecha de Información: 06 de octubre de jueves 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\$1704.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	347.4	353.6	128.5	188.0	182.1	116.4	43.0
15-35	558.6	494.6	205.8	147.0	115.8	238.6	173.0
36-60	77.0	9.5	0.0	66.7	9.5	10.3	0.0
61-90	10.5	67.4	40.0	0.0	17.4	0.5	10.0
91-180	1.5	6.9	0.0	0.0	6.9	1.5	0.0
>180	1.0	3.0	0.0	0.0	3.0	1.0	0.0
Total	996.0	934.9	374.3	401.7	334.6	368.3	226.0

* 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	6.9 %	7.4 %	7.0 %	7.1 %
15-35	7.2 %	7.6 %	7.2 %	7.3 %
36-60	-	7.4 %	7.0 %	7.1 %
61-90	7.0 %	6.8 %	5.8 %	6.8 %
91-180	-	6.5 %	5.8 %	6.3 %
>180	-	6.3 %	4.8 %	5.9 %
Total	7.2 %	7.4 %	7.1 %	7.2 %

*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**	26	129	5007	4000	22	151	3611	3250	16	96	2330	1981
Intragruppo y off-shore***	0	0	1999	1929	0	0	1485	1332	0	0	799	792
Otros	129	26	729	1800	151	22	973	1487	96	16	682	1039
Total	156	156	7736	7730	173	173	6068	6068	113	113	3812	3812

* 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.