

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2016

Fecha de Información: 10 de octubre de lunes 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\$186.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	39.0	26.9	0.1	2.0	11.8	22.0	15.0
15-35	81.3	24.6	13.0	78.5	11.6	2.8	0.0
36-60	0.3	3.6	0.0	0.0	3.6	0.2	0.0
61-90	1.1	15.7	10.0	1.0	5.7	0.1	0.0
91-180	0.2	6.7	0.0	0.0	6.7	0.2	0.0
>180	0.6	2.0	0.0	0.0	2.0	0.6	0.0
Total	122.4	79.6	23.1	81.5	41.4	25.9	15.0

* 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	3.2 %	6.8 %	3.6 %	4.2 %
15-35	-	7.3 %	6.8 %	7.0 %
36-60	6.5 %	7.3 %	5.3 %	7.2 %
61-90	-	6.7 %	6.0 %	6.6 %
91-180	-	6.6 %	5.7 %	6.6 %
>180	-	7.2 %	6.0 %	6.9 %
Total	3.2 %	7.1 %	5.7 %	6.0 %

*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	10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre				24 al 28 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	152	3802	3363	18	97	2469	2049	33	149	2655	2533
Intragruppo y off-shore***	0	0	1504	1398	0	0	800	813	0	0	1299	979
Otros	152	23	992	1537	97	18	707	1114	149	33	655	1079
Total	174	174	6298	6298	115	115	3976	3976	183	183	4609	4591

* 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.