

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2016

Fecha de Información: 11 de octubre de martes 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\$1550.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	376.4	326.1	172.7	178.9	19.8	63.9	133.5
15-35	534.4	340.2	128.5	253.4	117.2	186.5	94.5
36-60	17.3	33.5	25.0	5.6	3.5	6.7	5.0
61-90	6.5	9.3	0.0	0.0	9.3	6.5	0.0
91-180	53.6	66.1	20.0	41.0	41.1	7.6	5.0
>180	1.1	24.1	20.0	0.0	4.1	1.1	0.0
Total	989.3	799.2	366.3	478.9	195.0	272.4	238.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.3 %	7.6 %	6.9 %	7.2 %
15-35	7.4 %	7.3 %	7.2 %	7.3 %
36-60	6.8 %	7.2 %	6.5 %	7.0 %
61-90	-	9.0 %	6.1 %	7.8 %
91-180	6.1 %	6.4 %	6.3 %	6.3 %
>180	-	6.2 %	5.6 %	6.1 %
Total	7.3 %	7.3 %	7.0 %	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 intragruppo.

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**	24	150	3935	3550	23	97	2552	2145	33	150	2895	2634
Intragruppo y off-shore***	0	0	1612	1445	0	0	848	824	0	0	1355	1170
Otros	150	24	1003	1556	97	23	710	1141	150	33	680	1109
Total	174	174	6551	6551	120	120	4110	4110	183	183	4930	4912

* 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.