

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2016

Fecha de Información: 12 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\$1695.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.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	430.3	273.3	160.5	290.0	17.8	45.3	95.0
15-35	642.6	422.1	164.9	278.0	119.2	226.6	138.0
36-60	2.3	4.5	0.0	0.0	4.5	2.3	0.0
61-90	21.0	19.2	0.0	10.5	9.2	0.6	10.0
91-180	47.0	65.4	40.0	0.0	25.4	47.0	0.0
>180	10.2	0.7	0.0	10.0	0.7	0.2	0.0
Total	1153.4	785.2	365.4	588.5	176.8	322.0	243.0

* 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 %	7.0 %	6.7 %	6.9 %
15-35	7.3 %	7.3 %	7.1 %	7.2 %
36-60	-	7.5 %	6.4 %	7.1 %
61-90	6.6 %	6.7 %	6.2 %	6.6 %
91-180	-	6.2 %	5.9 %	6.1 %
>180	-	6.3 %	5.9 %	6.0 %
Total	7.1 %	7.0 %	6.9 %	7.0 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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**	25	155	4199	3649	23	96	2585	2251	34	149	3100	2760
Intragruppo y off-shore***	0	0	1636	1604	0	0	928	824	0	0	1441	1316
Otros	154	25	993	1575	96	23	726	1164	149	34	700	1147
Total	179	179	6829	6829	120	120	4239	4239	183	183	5241	5223

* 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.