

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2016

Fecha de Información: 14 de octubre de viernes 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\$1046.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	189.5	144.6	65.0	53.5	18.7	75.0	61.0
15-35	304.9	249.4	94.4	114.5	90.0	125.4	65.0
36-60	5.7	10.1	0.0	4.9	10.1	0.7	0.0
61-90	1.7	39.0	30.0	0.0	9.0	1.7	0.0
91-180	132.2	19.9	0.0	43.2	19.9	89.0	0.0
>180	70.9	4.5	0.0	0.0	4.5	70.9	0.0
Total	704.8	467.6	189.3	216.2	152.2	362.6	126.0

* 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	6.4 %	5.9 %	5.0 %	5.5 %
15-35	6.3 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	6.6 %	5.4 %	6.5 %
61-90	-	6.3 %	5.4 %	6.3 %
91-180	-	4.4 %	5.5 %	5.3 %
>180	-	6.5 %	5.2 %	5.3 %
Total	6.3 %	6.3 %	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**	24	143	4337	3713	34	103	2846	2422	43	149	3354	2996
Intragruppo y off-shore***	0	0	1663	1704	0	0	1011	953	0	0	1558	1393
Otros	142	24	995	1578	103	34	768	1250	149	43	715	1220
Total	167	167	6995	6995	136	136	4625	4625	192	192	5627	5609

* 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.