

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2016

Fecha de Información: 20 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\$1233.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.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	357.4	152.2	93.5	237.0	24.2	85.9	34.5
15-35	316.8	288.6	188.7	120.5	26.4	122.8	73.5
36-60	16.4	4.7	0.0	0.0	4.7	16.4	0.0
61-90	100.9	53.8	0.0	0.0	53.3	100.4	0.5
91-180	4.0	11.8	0.0	0.0	11.8	4.0	0.0
>180	31.7	3.4	0.0	19.2	3.4	12.5	0.0
Total	827.3	514.5	282.2	376.7	123.8	342.1	108.5

* 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 %	6.6 %	6.3 %	6.4 %
15-35	6.2 %	6.5 %	6.6 %	6.5 %
36-60	-	6.5 %	5.4 %	5.6 %
61-90	5.7 %	5.4 %	5.3 %	5.3 %
91-180	-	6.0 %	5.3 %	5.8 %
>180	-	6.6 %	5.6 %	5.7 %
Total	6.3 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %

*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	17 al 21 de octubre				24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	114	3230	2576	52	146	3763	3269	18	97	3017	2734
Intragruppo y off-shore***	0	0	1068	1228	0	0	1715	1636	0	0	1248	1178
Otros	114	29	780	1273	146	52	786	1341	97	18	752	1105
Total	143	143	5077	5077	198	198	6264	6246	114	114	5017	5017

* 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.