

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2016

Fecha de Información: 21 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\$1191.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.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	405.5	216.5	74.5	206.8	18.0	74.7	124.0
15-35	258.8	405.4	186.7	54.3	143.8	129.5	75.0
36-60	9.0	13.5	0.0	0.0	13.5	9.0	0.0
61-90	25.8	7.1	0.0	0.0	7.1	25.8	0.0
91-180	10.2	14.3	0.0	2.0	14.3	8.2	0.0
>180	7.5	16.8	2.2	0.0	14.7	7.5	0.0
Total	716.6	673.6	263.3	263.0	211.3	254.6	199.0

* 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	6.1 %	6.5 %	6.0 %	6.1 %
15-35	6.5 %	7.0 %	6.4 %	6.8 %
36-60	-	6.2 %	5.7 %	6.0 %
61-90	-	6.0 %	5.2 %	5.3 %
91-180	-	6.0 %	4.8 %	5.6 %
>180	-	6.0 %	5.3 %	5.8 %
Total	6.3 %	6.8 %	6.1 %	6.4 %

*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	117	3230	2575	53	146	4009	3415	18	99	3198	2801
Intragruppo y off-shore***	0	0	1068	1228	0	0	1780	1800	0	0	1258	1249
Otros	117	29	778	1273	146	53	799	1355	99	18	754	1161
Total	146	146	5076	5076	199	199	6588	6570	118	118	5211	5211

* 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.