

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2016

Fecha de Información: 24 de octubre de lunes 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\$1202.5 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	324.3	220.8	56.3	156.4	22.9	26.3	141.7
15-35	260.2	237.7	138.0	65.0	15.7	111.2	84.0
36-60	134.0	130.2	15.0	22.0	107.2	104.0	8.0
61-90	20.6	13.2	0.0	0.0	13.2	20.6	0.0
91-180	6.2	33.2	0.2	0.0	33.1	6.2	0.0
>180	33.8	22.1	20.0	11.5	2.1	22.3	0.0
Total	779.0	657.1	229.5	254.9	194.0	290.5	233.7

* 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	6.3 %	5.2 %	5.8 %	5.9 %
15-35	6.4 %	6.6 %	6.2 %	6.4 %
36-60	5.3 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
61-90	-	5.5 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.5 %	5.4 %	5.5 %
>180	-	5.7 %	5.7 %	5.7 %
Total	6.3 %	6.0 %	5.9 %	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

Sector	24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre				7 al 11 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	150	4162	3560	22	101	3365	2869	25	79	1793	1736
Intragruppo y off-shore***	0	0	1822	1847	0	0	1272	1358	0	0	764	699
Otros	150	53	806	1366	101	22	762	1172	79	25	644	765
Total	204	204	6790	6772	123	123	5399	5399	104	104	3201	3201

* 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.