

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2016

Fecha de Información: 25 de octubre de martes 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\$1263.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	295.0	127.1	76.0	201.0	18.1	61.0	33.0
15-35	373.3	397.9	254.0	103.5	18.9	144.8	125.0
36-60	58.6	45.6	2.0	0.0	33.6	48.6	10.0
61-90	26.2	3.1	0.0	0.0	3.1	26.2	0.0
91-180	5.6	13.8	0.0	0.0	13.8	5.6	0.0
>180	37.9	58.3	45.0	20.0	2.3	6.9	11.0
Total	796.7	645.9	377.0	324.5	89.9	293.1	179.0

* 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 %	6.6 %	5.1 %	5.7 %
15-35	6.2 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
36-60	5.3 %	6.0 %	5.7 %	5.8 %
61-90	-	6.3 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.9 %	5.2 %	5.7 %
>180	5.8 %	5.7 %	5.6 %	5.7 %
Total	6.2 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	54	150	4325	3617	26	101	3440	2902	28	79	1895	1824
Intragrupa y off-shore***	0	0	1848	1967	0	0	1287	1437	0	0	825	702
Otros	150	54	804	1375	101	26	780	1168	79	28	650	845
Total	204	204	6977	6959	127	127	5507	5507	106	106	3370	3370

* 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.