

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2016

Fecha de Información: 26 de octubre de miércoles 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\$1694.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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	289.8	213.1	77.2	136.4	62.4	79.8	73.5
15-35	530.4	481.7	272.9	168.3	64.3	217.6	144.5
36-60	54.0	63.7	23.1	4.0	33.1	42.6	7.4
61-90	86.5	6.1	0.0	29.7	6.1	56.9	0.0
91-180	33.2	13.5	4.0	20.0	9.5	13.2	0.0
>180	118.7	84.0	0.0	57.0	29.0	6.7	55.0
Total	1112.6	862.1	377.3	415.4	204.4	416.7	280.4

* 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	5.6 %	6.6 %	6.1 %	6.2 %
15-35	6.4 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
36-60	5.8 %	5.9 %	5.6 %	5.7 %
61-90	-	5.4 %	5.0 %	5.0 %
91-180	-	6.0 %	5.1 %	5.5 %
>180	5.7 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
Total	6.0 %	6.5 %	6.1 %	6.2 %

*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	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**	55	147	4438	3665	26	102	3479	2936	29	79	2138	1977
Intragruppo y off-shore***	0	0	1876	2061	0	0	1287	1442	0	0	874	774
Otros	147	55	807	1377	101	26	792	1181	79	29	697	958
Total	202	202	7121	7103	128	128	5558	5558	108	108	3709	3709

* 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.