

Fecha de Publicación: 2 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 31 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\$1129.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	219.4	173.8	107.0	122.0	9.8	40.4	57.0
15-35	292.4	289.8	177.8	146.3	70.3	104.3	41.8
36-60	41.4	50.5	5.2	0.0	45.3	41.4	0.0
61-90	37.1	29.0	0.0	0.1	29.0	37.1	0.0
91-180	25.3	50.0	10.0	0.0	40.0	25.3	0.0
>180	12.6	8.8	0.0	0.4	6.8	10.2	2.0
Total	628.2	602.0	300.0	268.7	201.2	258.7	100.8

* 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 %	6.3 %	4.3 %	5.5 %
15-35	5.8 %	6.3 %	6.0 %	6.1 %
36-60	-	6.1 %	5.4 %	5.7 %
61-90	-	3.5 %	4.8 %	4.2 %
91-180	-	5.1 %	5.3 %	5.2 %
>180	5.7 %	5.9 %	5.2 %	5.5 %
Total	6.0 %	6.0 %	5.4 %	5.7 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	31 de oct. al 4 de noviembre												7 al 11 de noviembre				14 al 18 de noviembre			
	Delivery				NDF				Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	34	103	3844	3243	32	77	2353	2163	30	84	1975	1778								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1464	1647	0	0	956	841	0	0	850	852								
Otros	103	34	821	1240	77	32	719	1023	84	30	620	815								
Total	137	137	6129	6129	109	109	4028	4028	114	114	3444	3444								

* 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.

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.