

Fecha de Publicación: 3 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$1599.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	256.3	226.5	137.5	161.5	21.0	26.8	68.0
15-35	457.5	431.9	275.1	222.0	55.9	134.5	101.0
36-60	60.1	56.0	26.0	9.9	25.0	45.2	5.0
61-90	41.4	13.9	0.0	0.0	13.9	41.4	0.0
91-180	72.9	36.8	0.0	35.0	31.8	32.9	5.0
>180	77.7	77.8	47.0	10.0	0.8	37.7	30.0
Total	965.9	842.9	485.6	438.4	148.3	318.5	209.0

* 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 %	1.8 %	4.5 %
15-35	6.1 %	6.3 %	6.1 %	6.2 %
36-60	5.7 %	6.0 %	5.7 %	5.8 %
61-90	-	5.6 %	5.7 %	5.6 %
91-180	5.3 %	5.7 %	5.3 %	5.4 %
>180	5.9 %	5.7 %	5.5 %	5.7 %
Total	6.1 %	6.2 %	5.0 %	5.6 %

*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
Sector Financiero**	35	98	4065	3384	36	79	2369	2245	36	85	2008	1811
Intragrupa y off-shore***	0	0	1537	1805	0	0	1009	841	0	0	862	863
Otros	98	35	832	1245	79	36	738	1029	85	36	641	837
Total	133	133	6434	6434	115	115	4115	4115	120	120	3511	3511

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.