

Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 02 de noviembre 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\$1581.2 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	331.1	237.5	151.9	217.7	11.6	39.4	74.0
15-35	349.2	434.0	267.8	114.0	43.3	112.2	123.0
36-60	109.1	108.6	0.0	2.1	38.6	37.0	70.0
61-90	71.8	15.4	0.0	0.0	15.4	71.8	0.0
91-180	19.5	16.5	0.0	0.0	6.5	9.5	10.0
>180	162.9	112.5	0.0	30.0	2.5	22.9	110.0
Total	1043.6	924.6	419.6	363.8	118.0	292.7	387.0

* 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 %	6.4 %	4.4 %	5.5 %
15-35	6.5 %	6.6 %	6.2 %	6.5 %
36-60	6.7 %	6.0 %	5.7 %	6.2 %
61-90	-	7.0 %	5.3 %	5.6 %
91-180	5.4 %	5.9 %	4.9 %	5.4 %
>180	5.7 %	6.1 %	5.5 %	5.7 %
Total	6.3 %	6.5 %	5.4 %	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

Sectores	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	100	4252	3483	37	81	2444	2355	36	84	2076	1884
Intragruppo y off-shore***	0	0	1592	1949	0	0	1086	875	0	0	917	903
Otros	100	35	849	1261	81	37	741	1041	84	36	642	848
Total	135	135	6693	6693	118	118	4271	4271	120	120	3635	3635

* 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.