

Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 03 de noviembre de jueves 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\$2020.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	313.2	375.1	216.0	127.8	15.6	42.0	143.5
15-35	665.4	551.9	326.1	286.0	12.8	166.4	213.0
36-60	70.5	58.1	0.0	0.0	58.1	70.5	0.0
61-90	92.3	32.3	15.0	10.0	7.3	72.3	10.0
91-180	53.8	63.8	0.0	0.0	41.8	31.8	22.0
>180	47.1	111.4	85.0	10.0	0.4	11.1	26.0
Total	1242.3	1192.6	642.1	433.8	136.0	394.1	414.5

* 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	6.5 %	6.4 %	3.3 %	5.6 %
15-35	6.5 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %
36-60	-	5.7 %	5.7 %	5.7 %
61-90	5.1 %	5.8 %	5.4 %	5.5 %
91-180	5.4 %	5.6 %	5.4 %	5.5 %
>180	5.7 %	5.6 %	5.3 %	5.6 %
Total	6.4 %	6.2 %	5.5 %	5.9 %

*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	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	101	4375	3567	38	80	2533	2489	36	84	2193	2058
Intragruppo y off-shore***	0	0	1644	2041	0	0	1140	875	0	0	1044	948
Otros	101	35	849	1261	80	38	750	1059	84	36	649	879
Total	136	136	6868	6868	118	118	4423	4423	121	121	3886	3886

* 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.