

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 04 de noviembre de viernes 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\$1290.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	128.4	146.4	63.1	8.0	17.3	54.4	66.0
15-35	413.6	247.4	82.0	208.5	7.9	47.6	157.5
36-60	98.1	95.8	0.0	0.1	95.8	98.0	0.0
61-90	121.5	141.8	20.0	20.1	121.8	101.5	0.0
91-180	3.3	33.5	10.0	0.0	23.5	3.3	0.0
>180	17.3	71.5	65.1	2.5	1.4	9.7	5.0
Total	782.1	736.4	240.2	239.2	267.7	314.5	228.5

* 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	6.4 %	6.5 %	5.0 %	6.0 %
15-35	6.6 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	6.0 %	5.9 %	5.9 %
61-90	-	6.0 %	5.8 %	5.9 %
91-180	-	5.9 %	4.8 %	5.8 %
>180	5.6 %	5.6 %	5.0 %	5.6 %
Total	6.5 %	6.2 %	6.0 %	6.1 %

*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	4375	3567	37	81	2613	2543	37	84	2242	2149
Intragruppo y off-shore***	0	0	1644	2041	0	0	1155	880	0	0	1092	951
Otros	100	35	849	1261	81	37	753	1098	84	37	660	894
Total	135	135	6869	6869	118	118	4521	4521	121	121	3994	3994

* 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.