

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2016

Fecha de Información: 04 de octubre de martes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1829.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	446.5	373.8	264.6	253.3	39.7	123.6	69.5
15-35	499.5	498.5	207.3	132.0	101.3	177.5	190.0
36-60	11.9	5.5	1.9	1.0	3.6	10.9	0.0
61-90	10.8	6.5	0.0	2.5	6.1	8.0	0.4
91-180	26.6	16.4	1.5	0.0	14.9	26.6	0.0
>180	122.8	140.8	43.0	0.0	27.8	52.8	70.0
Total	1118.0	1041.5	518.3	388.8	193.4	399.4	329.9

* 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	
3-14	9.6 %	3.8 %	6.5 %	5.7 %
15-35	7.4 %	7.3 %	7.0 %	7.2 %
36-60	-	6.9 %	6.6 %	6.7 %
61-90	6.2 %	6.7 %	5.9 %	6.3 %
91-180	-	6.5 %	5.7 %	6.0 %
>180	5.9 %	5.8 %	5.6 %	5.8 %
Total	7.5 %	5.6 %	6.6 %	6.4 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	3 al 7 de octubre				10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	130	4660	3823	17	149	3280	2945	16	96	2180	1843
Intragrupo y off-shore***	0	0	1917	1680	0	0	1314	1170	0	0	767	728
Otros	130	27	722	1790	149	17	848	1327	96	16	598	974
Total	157	157	7298	7292	166	166	5442	5442	112	112	3545	3545

* 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.