

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2016

Fecha de Información: 18 de octubre 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\$1343.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	277.4	201.7	118.5	181.3	46.2	59.2	37.0
15-35	373.6	263.0	76.3	154.5	111.7	144.1	75.0
36-60	12.5	42.7	30.0	10.0	12.7	2.5	0.0
61-90	3.9	35.7	20.6	0.0	15.1	3.9	0.0
91-180	83.8	79.6	0.0	30.6	79.6	53.1	0.0
>180	29.4	58.0	50.0	17.8	2.7	6.3	5.3
Total	780.6	680.6	295.4	394.2	267.9	269.1	117.3

* 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	4.7 %	6.5 %	5.9 %	6.0 %
15-35	6.4 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	4.9 %	1.2 %	4.0 %
61-90	-	6.1 %	5.4 %	6.0 %
91-180	-	5.8 %	5.5 %	5.7 %
>180	5.7 %	5.7 %	6.1 %	5.8 %
Total	5.8 %	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	17 al 21 de octubre				24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	103	2960	2493	49	150	3468	3104	18	97	2769	2604
Intragruppo y off-shore***	0	0	1055	1029	0	0	1618	1453	0	0	1160	1024
Otros	103	29	769	1261	150	49	752	1263	96	18	743	1043
Total	132	132	4783	4783	199	199	5838	5820	114	114	4671	4671

* 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.