

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2016

Fecha de Información: 19 de octubre de miércoles¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1546.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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 | 384.9 | 154.5 | 68.0 | 272.3 | 16.5 | 42.7 | 70.0 |
| 15-35 | 379.4 | 444.7 | 249.8 | 153.3 | 114.4 | 145.6 | 80.5 |
| 36-60 | 4.3 | 51.6 | 45.0 | 0.0 | 6.6 | 4.3 | 0.0 |
| 61-90 | 60.9 | 4.6 | 0.0 | 45.0 | 4.6 | 15.9 | 0.0 |
| 91-180 | 1.0 | 30.1 | 10.0 | 0.0 | 20.1 | 1.0 | 0.0 |
| >180 | 96.5 | 90.5 | 20.0 | 25.2 | 64.5 | 65.3 | 6.0 |
| Total | 927.0 | 776.1 | 392.8 | 495.7 | 226.8 | 274.8 | 156.5 |

* 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 | |
| 3-14 | 4.3 % | 5.2 % | 5.4 % | 5.2 % |
| 15-35 | 6.7 % | 6.4 % | 5.5 % | 6.0 % |
| 36-60 | - | 4.5 % | 5.7 % | 4.7 % |
| 61-90 | - | 11.7 % | 3.1 % | 4.2 % |
| 91-180 | - | 5.9 % | 5.5 % | 5.9 % |
| >180 | 5.6 % | 5.7 % | 5.9 % | 5.8 % |
| Total | 5.6 % | 6.0 % | 5.4 % | 5.7 % |

*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 | 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 | 116 | 3175 | 2561 | 49 | 147 | 3581 | 3180 | 18 | 97 | 2884 | 2683 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1068 | 1177 | 0 | 0 | 1665 | 1527 | 0 | 0 | 1205 | 1101 |
| Otros | 116 | 29 | 769 | 1273 | 147 | 49 | 772 | 1292 | 97 | 18 | 751 | 1056 |
| Total | 145 | 145 | 5011 | 5011 | 196 | 196 | 6017 | 5999 | 114 | 114 | 4841 | 4841 |

* 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.