

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 19 de septiembre de lunes 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\$1660.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.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	282.0	297.1	178.0	201.0	74.1	36.0	45.0
15-35	600.8	311.0	99.5	276.3	114.5	227.5	97.0
36-60	84.1	26.1	20.0	16.0	6.1	68.1	0.0
61-90	3.9	4.3	0.0	0.0	4.3	3.9	0.0
91-180	26.4	55.2	32.5	0.4	22.7	26.0	0.0
>180	60.1	51.5	0.0	10.0	51.5	50.1	0.0
Total	1057.3	745.1	330.0	503.7	273.1	411.6	142.0

* 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	3.8 %	8.3 %	6.5 %	7.1 %
15-35	4.3 %	7.5 %	6.8 %	6.6 %
36-60	-	7.5 %	6.9 %	7.0 %
61-90	-	6.6 %	1.7 %	4.3 %
91-180	-	6.6 %	6.2 %	6.5 %
>180	-	6.1 %	6.0 %	6.0 %
Total	4.2 %	7.6 %	6.6 %	6.7 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de septiembre				26 al 30 de septiembre				3 al 7 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	82	127	4376	4256	20	144	3224	3312	17	126	2914	2649
Intragruppo y off-shore***	0	55	2355	1916	0	0	1542	1194	0	0	1426	1116
Otros	127	27	868	1428	144	20	921	1180	126	17	489	1058
Total	209	209	7599	7599	164	164	5687	5687	143	143	4829	4823

* 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.