

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 23 de septiembre 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\$1714.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	500.5	418.5	186.2	111.0	67.4	224.5	165.0
15-35	512.5	335.7	112.5	195.7	20.7	114.3	202.5
36-60	8.7	14.8	0.0	0.0	14.8	8.7	0.0
61-90	9.2	37.8	20.0	0.0	17.8	9.2	0.0
91-180	9.0	15.0	0.0	0.0	15.0	9.0	0.0
>180	104.9	155.3	23.5	0.0	91.8	64.9	40.0
Total	1144.8	977.1	342.2	306.7	227.5	430.6	407.5

* 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	5.9 %	6.6 %	6.2 %	6.3 %
15-35	6.6 %	7.2 %	6.3 %	6.6 %
36-60	-	7.4 %	6.2 %	7.0 %
61-90	-	6.7 %	6.1 %	6.6 %
91-180	-	7.3 %	5.9 %	6.7 %
>180	5.6 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
Total	6.2 %	6.7 %	6.2 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	79	123	5145	4601	24	136	4101	4121	20	134	3401	3005
Intragruppo y off-shore***	0	55	2465	2367	0	0	1937	1450	0	0	1508	1336
Otros	123	24	961	1603	136	24	1040	1507	134	20	632	1195
Total	203	203	8572	8572	160	160	7078	7078	154	154	5542	5536

* 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.