

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1397.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.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	379.3	282.9	146.8	76.0	18.0	185.1	118.2
15-35	368.8	344.7	132.9	123.8	123.8	157.0	88.0
36-60	27.2	1.3	0.0	20.0	1.3	7.2	0.0
61-90	18.7	3.1	0.0	10.0	3.1	8.7	0.0
91-180	17.1	52.6	23.0	0.0	29.6	17.1	0.0
>180	46.0	61.7	10.0	0.0	51.7	46.0	0.0
Total	857.1	746.2	312.7	229.8	227.3	421.1	206.2

* 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	6.8 %	8.2 %	7.4 %	7.5 %
15-35	6.9 %	6.8 %	6.7 %	6.8 %
36-60	-	7.1 %	6.4 %	6.4 %
61-90	-	6.9 %	6.3 %	6.4 %
91-180	-	5.9 %	5.9 %	5.9 %
>180	-	5.9 %	5.8 %	5.9 %
Total	6.8 %	7.1 %	6.9 %	6.9 %

*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	26 al 30 de septiembre				3 al 7 de octubre				10 al 14 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	138	4404	4326	18	134	3476	3083	11	144	2761	2369
Intragruppo y off-shore***	0	0	2077	1523	0	0	1516	1338	0	0	1059	994
Otros	138	25	1041	1673	134	18	648	1213	144	11	613	1070
Total	163	163	7522	7522	152	152	5640	5634	155	155	4433	4433

* 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.