

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 28 de septiembre de miércoles 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\$1573.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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	617.9	224.8	99.5	350.0	37.6	180.2	87.7
15-35	325.4	501.7	359.7	94.5	71.6	160.5	70.4
36-60	1.3	3.1	0.2	0.0	3.0	1.3	0.0
61-90	5.0	34.6	10.7	0.0	23.9	5.0	0.0
91-180	3.4	9.8	0.0	0.0	9.8	3.4	0.0
>180	0.8	3.4	0.0	0.0	3.4	0.8	0.0
Total	953.7	777.5	470.1	444.5	149.3	351.1	158.1

* 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	7.1 %	7.0 %	4.3 %	5.3 %
15-35	6.0 %	7.4 %	6.8 %	7.0 %
36-60	-	7.2 %	5.5 %	6.7 %
61-90	-	6.6 %	6.1 %	6.5 %
91-180	-	6.3 %	5.9 %	6.2 %
>180	-	6.0 %	5.3 %	5.9 %
Total	6.6 %	7.2 %	5.2 %	6.2 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	26	144	4879	4478	23	133	3873	3200	15	146	2852	2468
Intragrupa y off-shore***	0	0	2111	1872	0	0	1612	1425	0	0	1101	1031
Otros	144	26	1037	1677	133	23	649	1503	146	15	655	1110
Total	170	170	8027	8027	156	156	6134	6128	161	161	4609	4609

* 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.

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.