

Fecha de Publicación: 3 de agosto de 2016

Fecha de Información: 01 de agosto 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\$1157.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.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	98.0	280.3	142.3	45.0	123.0	38.0	15.0
15-35	295.4	344.7	170.1	105.0	42.6	58.4	132.0
36-60	9.3	4.8	0.0	0.0	4.8	9.3	0.0
61-90	0.7	31.5	0.0	0.0	31.5	0.7	0.0
91-180	26.7	16.5	0.0	2.7	16.5	24.0	0.0
>180	93.8	102.9	20.0	0.0	82.9	93.8	0.0
Total	523.9	780.7	332.4	152.7	301.3	224.2	147.0

* 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	7.6 %	8.4 %	8.1 %	8.3 %
15-35	7.3 %	8.0 %	7.6 %	7.7 %
36-60	-	8.4 %	6.9 %	7.4 %
61-90	-	8.0 %	2.3 %	7.8 %
91-180	-	6.9 %	6.9 %	6.9 %
>180	-	7.0 %	6.6 %	6.8 %
Total	7.3 %	7.9 %	7.4 %	7.7 %

*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	1 al 5 de agosto				8 al 12 de agosto				15 al 19 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	77	2915	3128	16	92	3265	3225	19	74	2319	2594
Intragrupa y off-shore***	0	0	1571	906	0	0	1528	839	0	0	1492	734
Otros	77	21	698	1149	92	16	761	1450	74	19	482	953
Total	98	98	5183	5183	108	108	5555	5515	94	94	4292	4281

* 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.