

Fecha de Publicación: 4 de agosto de 2016

Fecha de Información: 02 de agosto de martes 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\$1366.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	338.3	331.3	98.0	154.0	131.3	82.3	102.0
15-35	323.3	507.0	336.0	62.3	47.0	137.0	124.0
36-60	10.6	2.4	0.0	0.0	2.4	10.6	0.0
61-90	10.6	3.5	0.0	0.2	3.5	10.5	0.0
91-180	7.4	12.8	0.0	0.2	11.6	6.0	1.2
>180	33.7	12.9	0.0	0.0	12.9	33.7	0.0
Total	723.8	869.8	434.0	216.6	208.7	280.0	227.2

* 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 Aualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.2 %	8.0 %	7.0 %	7.4 %
15-35	7.9 %	6.7 %	7.3 %	7.1 %
36-60	-	8.0 %	7.2 %	7.4 %
61-90	-	8.3 %	7.4 %	7.6 %
91-180	7.2 %	8.3 %	7.1 %	7.9 %
>180	-	7.6 %	6.8 %	7.0 %
Total	7.6 %	7.1 %	7.1 %	7.2 %

*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

Sectores	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**	24	78	3182	3316	19	91	3313	3339	21	75	2350	2695		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1595	1053	0	0	1589	841	0	0	1557	739		
Otros	78	24	797	1204	91	19	777	1459	75	21	518	979		
Total	102	102	5573	5573	110	110	5679	5639	96	96	4424	4413		

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