

Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2016

Fecha de Información: 03 de agosto 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\$1786.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	397.1	378.2	141.1	336.0	202.1	26.1	35.0
15-35	392.8	587.1	507.2	96.6	7.8	224.0	72.2
36-60	3.6	7.9	0.0	0.0	7.9	3.6	0.0
61-90	17.9	9.8	0.0	0.0	9.8	17.9	0.0
91-180	16.6	36.2	20.0	0.0	14.2	14.6	2.0
>180	31.0	33.6	10.0	10.0	7.2	4.6	16.4
Total	859.1	1052.8	678.3	442.6	248.9	290.9	125.6

* 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	8.2 %	7.9 %	4.4 %	6.4 %
15-35	8.3 %	8.4 %	8.0 %	8.3 %
36-60	-	8.8 %	7.1 %	8.3 %
61-90	-	7.9 %	7.4 %	7.6 %
91-180	7.5 %	7.8 %	7.0 %	7.5 %
>180	7.1 %	7.9 %	6.4 %	7.2 %
Total	8.1 %	8.2 %	6.2 %	7.4 %

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

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	83	3523	3462	17	90	3366	3548	21	75	2376	2757
Intragruppo y off-shore***	0	0	1613	1385	0	0	1712	845	0	0	1578	739
Otros	83	24	921	1209	90	17	833	1477	75	21	538	986
Total	107	107	6056	6056	107	107	5910	5870	96	96	4492	4481

* 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.