

Fecha de Publicación: 8 de agosto de 2016

Fecha de Información: 04 de agosto de jueves 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\$1397.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	243.5	339.7	113.1	142.8	142.6	16.7	84.0
15-35	372.1	338.7	231.0	201.8	20.1	82.7	87.6
36-60	7.0	7.7	1.0	0.0	5.3	5.6	1.4
61-90	20.5	40.4	30.0	10.0	10.4	10.5	0.0
91-180	11.9	59.8	35.0	0.0	14.8	1.9	10.0
>180	71.6	67.7	0.0	0.0	67.7	71.6	0.0
Total	726.5	854.0	410.1	354.5	260.8	189.0	183.0

* 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	8.2 %	8.2 %	6.8 %	7.9 %
15-35	8.2 %	8.9 %	7.4 %	8.1 %
36-60	7.8 %	6.3 %	7.8 %	7.1 %
61-90	-	7.8 %	7.6 %	7.8 %
91-180	7.3 %	7.4 %	5.6 %	7.3 %
>180	-	6.8 %	6.8 %	6.8 %
Total	8.1 %	8.2 %	7.2 %	7.8 %

*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**	23	77	3520	3462	16	104	3369	3539	21	76	2376	2754
Intragruppo y off-shore***	0	0	1613	1385	0	0	1712	845	0	0	1578	739
Otros	77	23	921	1206	104	16	824	1480	76	21	536	986
Total	101	101	6053	6053	120	120	5904	5864	97	97	4489	4478

* 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.