

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2016

Fecha de Información: 08 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\$1133.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.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	194.8	155.2	64.3	117.8	35.8	22.0	55.0
15-35	464.2	267.9	77.1	196.5	108.8	185.7	82.0
36-60	13.4	22.2	0.0	0.0	17.2	8.4	5.0
61-90	3.2	37.0	0.0	0.0	37.0	3.2	0.0
91-180	10.3	49.7	0.0	0.7	49.7	9.6	0.0
>180	24.4	38.2	0.0	0.0	33.2	19.4	5.0
Total	710.2	570.2	141.4	315.0	281.7	248.2	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	7.1 %	7.7 %	7.5 %	7.5 %
15-35	8.1 %	8.1 %	7.3 %	7.7 %
36-60	8.0 %	8.2 %	7.9 %	8.1 %
61-90	-	8.3 %	7.2 %	8.2 %
91-180	-	7.6 %	6.8 %	7.5 %
>180	6.4 %	7.3 %	6.8 %	7.0 %
Total	7.6 %	7.9 %	7.3 %	7.6 %

*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	8 al 12 de agosto				15 al 19 de agosto				22 al 26 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	109	3357	3522	21	76	2379	2749	257	97	1991	2075
Intragrupa y off-shore***	0	0	1712	845	0	0	1578	739	0	115	959	540
Otros	109	16	807	1469	76	21	530	989	97	142	510	839
Total	125	125	5876	5836	97	97	4487	4476	354	354	3460	3455

* 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.