

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2016

Fecha de Información: 11 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\$1578.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.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	356.6	253.4	70.0	154.0	102.4	121.6	81.0
15-35	499.7	286.2	141.0	297.8	104.2	160.9	41.0
36-60	21.7	55.7	0.0	9.2	51.7	8.6	4.0
61-90	23.1	72.3	10.0	0.0	62.3	23.1	0.0
91-180	0.0	84.5	22.9	0.0	61.7	0.0	0.0
>180	25.5	36.0	15.0	4.5	11.0	11.0	10.0
Total	926.7	788.2	258.9	465.5	393.3	325.2	136.0

* 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 %	7.7 %	7.9 %
15-35	8.0 %	8.2 %	7.5 %	7.8 %
36-60	8.2 %	8.8 %	6.9 %	8.5 %
61-90	-	8.3 %	7.7 %	8.1 %
91-180	-	7.8 %	7.3 %	7.8 %
>180	6.9 %	7.1 %	6.9 %	7.0 %
Total	8.1 %	8.1 %	7.6 %	7.9 %

*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	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**	17	106	4684	4257	21	100	2638	3186	257	106	2317	2462
Intragruppo y off-shore***	0	0	1940	1702	3	0	1742	800	0	115	1056	598
Otros	106	17	1019	1645	98	21	684	1067	106	142	676	984
Total	123	123	7644	7604	122	122	5064	5053	363	363	4049	4044

* 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.