

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2016

Fecha de Información: 16 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\$2007.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.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	556.2	264.5	35.0	375.0	102.0	53.7	127.5
15-35	589.9	736.7	415.8	175.3	162.4	256.1	158.5
36-60	30.3	73.8	0.0	0.0	43.8	0.3	30.0
61-90	3.3	22.4	0.5	0.0	19.1	0.5	2.8
91-180	16.9	23.0	0.0	0.5	20.5	13.9	2.5
>180	0.0	12.4	0.0	0.0	12.4	0.0	0.0
Total	1196.5	1132.7	451.3	550.8	360.1	324.4	321.3

* 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	8.6 %	7.9 %	5.9 %	6.9 %
15-35	7.9 %	8.5 %	8.6 %	8.5 %
36-60	7.6 %	8.3 %	7.6 %	8.0 %
61-90	8.0 %	8.1 %	7.5 %	8.1 %
91-180	7.3 %	7.9 %	7.6 %	7.8 %
>180	-	7.4 %	-	7.4 %
Total	8.1 %	8.3 %	7.4 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	15 al 19 de agosto				22 al 26 de agosto				29 de ago. al 2 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	100	3388	3565	257	109	2418	2614	37	164	2948	3790
Intragruppo y off-shore***	3	0	1789	1250	0	115	1110	635	0	0	2208	747
Otros	97	21	837	1188	109	142	745	1018	164	37	691	1306
Total	120	120	6015	6004	366	366	4272	4267	201	201	5848	5843

* 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.