

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2016

Fecha de Información: 17 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\$1676.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.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	439.3	217.3	92.0	333.0	28.3	9.3	97.0
15-35	494.8	480.9	305.0	121.3	54.4	252.1	121.5
36-60	19.0	31.2	0.0	0.5	20.7	8.0	10.5
61-90	1.3	4.2	0.0	0.0	4.2	1.3	0.0
91-180	55.6	22.2	0.0	45.7	17.2	4.9	5.0
>180	83.3	80.8	0.9	0.0	60.0	63.3	20.0
Total	1093.3	836.7	397.8	500.4	184.8	338.9	254.0

* 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	8.1 %	8.6 %	7.0 %	7.8 %
15-35	8.0 %	9.4 %	7.5 %	8.3 %
36-60	8.1 %	8.2 %	7.6 %	8.0 %
61-90	-	8.2 %	7.6 %	8.1 %
91-180	7.4 %	7.7 %	7.2 %	7.4 %
>180	6.9 %	7.0 %	6.9 %	7.0 %
Total	8.0 %	8.8 %	7.3 %	8.0 %

*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	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**	20	100	3672	3597	257	113	2535	2722	37	165	3001	3877
Intragruppo y off-shore***	3	0	1795	1489	0	115	1181	727	0	0	2233	749
Otros	97	20	836	1206	113	142	762	1023	165	37	703	1306
Total	120	120	6303	6292	371	371	4478	4473	202	202	5937	5932

* 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.