

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2016

Fecha de Información: 18 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\$1546.2 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	322.5	296.7	59.2	161.5	119.5	43.0	118.0
15-35	545.3	316.5	174.6	283.0	55.0	175.4	87.0
36-60	50.4	75.3	1.5	0.0	58.8	35.4	15.0
61-90	0.5	19.9	0.8	0.0	19.1	0.5	0.0
91-180	7.4	65.6	0.1	0.0	64.5	6.4	1.0
>180	42.8	55.5	5.0	11.5	19.2	0.0	31.3
Total	968.9	829.6	241.1	456.0	336.1	260.6	252.3

* 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	5.9 %	8.4 %	7.1 %	7.3 %
15-35	7.7 %	8.5 %	7.7 %	7.8 %
36-60	8.0 %	8.1 %	7.8 %	8.0 %
61-90	-	8.3 %	7.4 %	8.3 %
91-180	7.6 %	7.7 %	6.8 %	7.7 %
>180	6.9 %	7.2 %	6.8 %	7.0 %
Total	6.8 %	8.2 %	7.5 %	7.6 %

*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	98	3821	3658	256	117	2610	2845	35	166	3101	3990
Intragruppo y off-shore***	3	0	1814	1595	0	115	1201	768	0	0	2253	764
Otros	95	21	840	1212	117	141	840	1032	166	35	741	1337
Total	119	119	6475	6464	373	373	4650	4645	201	201	6096	6091

* 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.