

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2016

Fecha de Información: 19 de agosto de viernes 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\$1526.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	279.5	271.5	102.0	156.0	129.5	83.5	40.0
15-35	574.5	255.9	138.5	349.0	55.9	164.0	61.5
36-60	35.9	41.9	0.1	0.0	41.8	35.9	0.0
61-90	3.1	38.2	1.0	0.0	37.2	3.1	0.0
91-180	29.2	82.1	0.0	0.0	59.6	6.7	22.5
>180	7.7	36.3	0.0	0.0	31.3	2.7	5.0
Total	929.9	725.9	241.6	505.0	355.3	295.9	129.0

* 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	6.8 %	7.7 %	6.1 %	6.9 %
15-35	7.7 %	7.6 %	7.6 %	7.6 %
36-60	-	8.2 %	7.6 %	7.9 %
61-90	-	8.1 %	7.5 %	8.0 %
91-180	7.4 %	7.8 %	7.1 %	7.6 %
>180	6.9 %	7.2 %	6.8 %	7.2 %
Total	7.3 %	7.7 %	7.1 %	7.4 %

*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**	24	99	3821	3658	253	119	2779	2979	35	166	3212	4122
Intragruppo y off-shore***	3	0	1814	1595	0	115	1239	904	0	0	2317	784
Otros	96	24	841	1212	119	138	921	1050	166	35	784	1402
Total	122	122	6476	6465	371	371	4939	4934	201	201	6313	6308

* 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.