

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2016

Fecha de Información: 22 de agosto de lunes 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\$1370.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.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	375.8	349.8	136.0	143.5	113.3	131.8	100.5
15-35	219.0	336.1	224.3	90.0	46.4	63.5	65.5
36-60	4.3	5.7	0.0	0.0	5.7	4.3	0.0
61-90	5.1	3.9	0.0	0.0	3.9	5.1	0.0
91-180	1.5	31.9	0.0	0.0	31.9	1.5	0.0
>180	143.5	110.0	0.0	32.5	60.0	61.0	50.0
Total	749.1	837.4	360.3	266.0	261.2	267.1	216.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.1 %	6.6 %	5.6 %	6.1 %
15-35	7.7 %	8.2 %	7.4 %	7.9 %
36-60	-	8.2 %	7.3 %	7.9 %
61-90	-	8.2 %	7.0 %	7.6 %
91-180	-	7.6 %	7.1 %	7.6 %
>180	6.9 %	6.9 %	6.9 %	6.9 %
Total	6.8 %	7.4 %	6.4 %	6.9 %

* 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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	22 al 26 de agosto				29 de ago. al 2 de septiembre				5 al 9 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	254	121	3023	3162	55	164	3323	4288	7	59	2138	1926
Intragrupa y off-shore***	0	115	1306	1027	0	0	2386	805	0	0	1134	906
Otros	121	139	1006	1141	164	55	811	1422	59	7	390	830
Total	375	375	5334	5329	219	219	6520	6515	66	66	3662	3662

* 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.