

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2016

Fecha de Información: 24 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\$1722.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.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	512.3	188.8	23.0	386.9	67.8	27.4	98.0
15-35	487.1	653.9	351.6	132.0	50.3	103.1	252.0
36-60	0.5	4.5	0.0	0.0	4.5	0.5	0.0
61-90	2.4	68.1	10.0	0.0	58.1	2.4	0.0
91-180	0.1	41.9	35.0	0.0	6.9	0.1	0.0
>180	47.1	75.9	20.0	36.0	45.9	1.1	10.0
Total	1049.6	1033.1	439.6	554.9	233.5	134.7	360.0

* 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	6.3 %	7.3 %	3.0 %	4.9 %
15-35	7.9 %	7.9 %	7.6 %	7.8 %
36-60	-	7.8 %	6.7 %	7.7 %
61-90	-	8.7 %	7.4 %	8.6 %
91-180	-	7.4 %	7.1 %	7.4 %
>180	6.8 %	7.0 %	6.8 %	6.9 %
Total	7.5 %	7.8 %	5.5 %	7.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	134	3608	3455	91	163	3636	4435	8	59	2345	2114
Intragrupoy off-shore***	0	115	1328	1415	0	14	2434	999	0	0	1206	976
Otros	134	139	1124	1184	163	77	845	1476	59	8	421	882
Total	388	388	6060	6055	254	254	6915	6910	67	67	3972	3972

* 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.