

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2016

Fecha de Información: 25 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\$1426.1 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	242.7	253.1	70.0	130.3	110.1	39.4	73.0
15-35	592.4	343.6	208.3	309.3	94.3	242.2	41.0
36-60	18.1	4.5	0.0	0.0	4.5	18.1	0.0
61-90	5.1	12.8	0.3	0.0	7.6	0.1	5.0
91-180	24.2	18.3	0.0	0.0	18.3	24.2	0.0
>180	13.6	16.6	14.5	0.0	2.1	13.6	0.0
Total	896.2	648.9	293.1	439.6	236.8	337.7	119.0

* 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	7.5 %	8.2 %	7.8 %	7.9 %
15-35	7.7 %	7.7 %	7.5 %	7.6 %
36-60	-	8.2 %	7.5 %	7.6 %
61-90	7.2 %	9.9 %	7.1 %	8.8 %
91-180	-	7.3 %	6.8 %	7.0 %
>180	-	6.9 %	6.7 %	6.8 %
Total	7.5 %	7.8 %	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	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	137	3612	3523	92	142	3811	4563	9	60	2407	2189
Intragruppo y off-shore***	0	115	1357	1419	0	14	2434	1103	0	0	1247	998
Otros	137	139	1163	1184	142	77	931	1504	60	9	425	892
Total	391	391	6132	6127	233	233	7176	7171	69	69	4079	4079

* 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.