

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2016

Fecha de Información: 29 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\$1573.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	434.2	240.8	111.0	289.0	43.2	58.7	86.5
15-35	307.2	549.4	337.3	62.8	76.2	108.4	136.0
36-60	3.8	1.5	0.0	0.0	1.5	3.8	0.0
61-90	5.4	14.1	0.0	0.0	14.1	5.4	0.0
91-180	59.7	56.5	0.0	40.0	38.5	1.7	18.0
>180	72.9	68.8	0.0	0.0	68.8	72.9	0.0
Total	883.2	931.1	448.3	391.8	242.3	250.9	240.6

* 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	9.3 %	7.7 %	6.0 %	7.1 %
15-35	7.6 %	7.3 %	6.5 %	7.1 %
36-60	-	8.0 %	7.1 %	7.3 %
61-90	-	7.1 %	5.0 %	6.5 %
91-180	7.0 %	7.2 %	7.0 %	7.1 %
>180	-	6.9 %	6.8 %	6.8 %
Total	8.1 %	7.3 %	6.3 %	7.1 %

*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	29 de ago. al 2 de septiembre				5 al 9 de septiembre				12 al 16 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	97	155	4307	4935	12	61	2540	2259	14	137	3234	2593
Intragruppo y off-shore***	0	14	2562	1388	0	0	1279	1090	0	0	1068	1007
Otros	155	83	1063	1604	61	12	444	914	137	14	910	1612
Total	252	252	7932	7927	73	73	4262	4262	151	151	5212	5212

* 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.