

Fecha de Publicación: 2 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 31 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\$1938.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.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	616.1	205.8	85.1	538.0	100.8	58.1	20.0
15-35	380.2	621.0	371.5	75.8	114.5	169.5	135.0
36-60	6.7	4.0	0.0	0.0	4.0	6.7	0.0
61-90	1.2	14.2	0.0	0.0	14.2	1.2	0.0
91-180	113.7	135.0	50.0	50.0	70.0	48.7	15.0
>180	6.9	9.0	0.0	0.0	4.0	1.9	5.0
Total	1124.8	989.1	506.6	663.8	307.5	286.0	175.0

* 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	3.8 %	7.6 %	4.1 %	5.3 %
15-35	7.4 %	7.5 %	7.1 %	7.4 %
36-60	-	7.5 %	7.0 %	7.2 %
61-90	-	7.4 %	6.6 %	7.3 %
91-180	6.9 %	7.1 %	6.9 %	6.9 %
>180	6.6 %	7.1 %	6.3 %	6.7 %
Total	6.9 %	7.5 %	5.7 %	6.7 %

*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	161	4687	5053	12	61	2633	2388	16	137	3352	2747
Intragrupoy off-shore***	0	14	2580	1725	0	0	1329	1128	0	0	1119	1027
Otros	161	83	1138	1622	61	12	499	944	137	16	993	1690
Total	258	258	8405	8400	73	73	4461	4461	153	153	5465	5465

* 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.