

Fecha de Publicación: 6 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 02 de septiembre de viernes 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\$2365.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.3%.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	623.9	638.1	207.0	261.0	206.3	138.1	224.8
15-35	571.9	599.7	475.0	201.0	64.7	310.9	60.0
36-60	3.0	13.7	0.0	0.0	13.7	3.0	0.0
61-90	16.9	9.9	0.0	0.0	9.9	16.9	0.0
91-180	80.2	80.4	0.0	30.0	30.4	0.2	50.0
>180	55.7	7.4	0.0	0.0	7.4	55.7	0.0
Total	1351.4	1349.1	682.0	492.0	332.3	524.6	334.8

* 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	7.9 %	7.9 %	6.7 %	7.4 %
15-35	4.2 %	7.2 %	7.5 %	7.2 %
36-60	-	8.4 %	7.0 %	8.1 %
61-90	-	7.7 %	6.9 %	7.2 %
91-180	7.1 %	7.8 %	6.6 %	7.2 %
>180	-	6.9 %	6.3 %	6.3 %
Total	7.1 %	7.5 %	7.1 %	7.3 %

*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	157	5188	5159	57	73	3399	3081	18	140	3707	3160
Intragruppo y off-shore***	0	14	2620	2188	0	0	1589	1584	0	0	1299	1102
Otros	157	83	1170	1626	73	57	735	1058	140	18	1082	1825
Total	254	254	8977	8972	130	130	5723	5723	158	158	6088	6088

* 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.