

Fecha de Publicación: 7 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 05 de septiembre 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\$80.9 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	8.2	11.8	11.0	3.0	0.8	5.2	0.0
15-35	14.8	24.9	17.0	12.5	7.9	2.3	0.0
36-60	0.9	1.7	0.0	0.0	1.7	0.9	0.0
61-90	0.5	3.5	0.0	0.0	3.5	0.5	0.0
91-180	4.5	7.2	0.0	0.0	7.2	4.5	0.0
>180	0.7	2.2	0.0	0.0	2.2	0.7	0.0
Total	29.5	51.4	28.0	15.5	23.4	14.0	0.0

* 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	-	7.9 %	4.2 %	6.8 %
15-35	-	8.0 %	7.6 %	7.9 %
36-60	-	7.7 %	6.5 %	7.3 %
61-90	-	7.4 %	5.6 %	7.1 %
91-180	-	7.2 %	6.0 %	6.8 %
>180	-	6.5 %	3.9 %	5.9 %
Total	-	7.7 %	6.5 %	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	5 al 9 de septiembre				12 al 16 de septiembre				19 al 23 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	68	3395	3083	18	141	3687	3140	18	118	3304	2650
Intragruppo y off-shore***	0	0	1600	1587	0	0	1299	1102	0	0	1426	1416
Otros	68	55	736	1061	141	18	1083	1825	117	17	589	1253
Total	123	123	5731	5731	159	159	6068	6068	135	135	5319	5319

* 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.