

Fecha de Publicación: 8 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 06 de septiembre de martes 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\$1744.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.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	400.0	357.0	182.6	266.3	99.4	58.7	75.0
15-35	630.5	239.7	76.2	381.6	86.5	171.9	77.0
36-60	21.6	58.1	30.0	0.0	16.6	10.1	11.5
61-90	0.0	29.1	0.0	0.0	29.1	0.0	0.0
91-180	1.6	38.5	0.0	0.0	38.5	1.6	0.0
>180	72.1	80.5	0.0	0.0	59.5	51.1	21.0
Total	1125.8	802.9	288.7	647.9	329.7	293.4	184.5

* 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	6.8 %	8.5 %	7.5 %	7.9 %
15-35	7.7 %	7.9 %	7.9 %	7.9 %
36-60	7.0 %	7.7 %	7.2 %	7.5 %
61-90	-	7.5 %	6.0 %	7.5 %
91-180	-	7.3 %	6.5 %	7.3 %
>180	6.4 %	6.8 %	6.7 %	6.7 %
Total	7.1 %	8.0 %	7.7 %	7.7 %

*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	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**	54	67	3375	3170	18	145	3710	3102	17	123	3354	2679
Intragruppo y off-shore***	0	0	1665	1568	0	0	1308	1169	0	0	1443	1490
Otros	67	54	733	1035	145	18	1072	1819	123	17	576	1204
Total	121	121	5773	5773	163	163	6090	6090	140	140	5373	5373

* 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.