

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 07 de septiembre 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\$2185.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.3%.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	483.6	265.7	76.6	372.8	114.1	35.9	75.0
15-35	665.1	597.1	318.1	264.3	60.5	182.3	218.5
36-60	0.6	29.3	0.0	0.0	29.3	0.6	0.0
61-90	117.4	77.6	1.9	67.0	75.7	50.3	0.0
91-180	11.4	136.9	3.1	10.0	133.8	1.4	0.0
>180	47.0	53.6	33.1	10.0	14.5	31.0	6.0
Total	1325.1	1160.1	432.8	724.1	427.8	301.6	299.5

* 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	7.5 %	8.2 %	6.5 %	7.2 %
15-35	7.9 %	7.9 %	6.9 %	7.5 %
36-60	-	7.9 %	7.0 %	7.9 %
61-90	-	7.1 %	6.8 %	6.9 %
91-180	-	7.1 %	6.8 %	7.0 %
>180	6.1 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
Total	7.8 %	7.7 %	6.7 %	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	67	3700	3292	20	149	3864	3184	21	125	3374	2753
Intragruppo y off-shore***	0	0	1668	1807	0	0	1331	1293	0	0	1506	1503
Otros	67	55	776	1046	149	20	1131	1850	125	21	586	1209
Total	122	122	6145	6145	168	168	6326	6326	146	146	5466	5466

* 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.