

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 09 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\$1382.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	307.9	407.1	149.6	82.8	106.5	74.0	151.0
15-35	469.5	338.3	231.5	240.0	38.8	161.5	68.0
36-60	2.3	9.5	0.0	0.0	9.5	2.3	0.0
61-90	11.7	18.4	0.0	1.3	8.4	0.4	10.0
91-180	26.2	8.7	0.0	0.0	8.7	26.2	0.0
>180	10.7	1.8	0.3	0.0	1.5	10.7	0.0
Total	828.2	783.7	381.4	324.1	173.3	275.1	229.0

* 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	7.8 %	7.2 %	7.0 %	7.4 %
15-35	7.8 %	7.9 %	7.4 %	7.6 %
36-60	7.5 %	7.8 %	6.1 %	7.4 %
61-90	6.6 %	7.3 %	7.0 %	6.9 %
91-180	-	7.8 %	6.2 %	6.6 %
>180	-	7.1 %	6.1 %	6.3 %
Total	7.7 %	7.6 %	7.2 %	7.5 %

*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	65	3882	3375	22	157	4214	3671	21	126	3617	3089
Intragruppo y off-shore***	0	0	1679	1940	0	0	1505	1403	0	0	1640	1544
Otros	65	54	792	1038	157	22	1313	1958	126	20	640	1264
Total	119	119	6353	6353	179	179	7032	7032	146	146	5897	5897

* 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.