

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 15 de septiembre de jueves 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\$1570.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	322.6	222.5	88.0	207.0	59.5	40.6	75.0
15-35	615.9	423.7	220.5	201.8	101.2	312.1	102.0
36-60	44.4	6.4	0.0	0.0	6.4	44.4	0.0
61-90	0.4	30.5	20.5	0.0	10.0	0.4	0.0
91-180	15.9	25.1	0.0	10.1	20.3	1.0	4.8
>180	3.6	41.3	40.0	0.5	1.3	3.0	0.0
Total	1002.8	749.6	369.0	419.4	198.7	401.6	181.8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.7 %	6.3 %	6.4 %	6.6 %
15-35	7.6 %	7.3 %	7.4 %	7.4 %
36-60	-	8.2 %	7.3 %	7.4 %
61-90	-	7.2 %	6.3 %	7.2 %
91-180	6.7 %	6.8 %	6.4 %	6.7 %
>180	-	6.4 %	6.0 %	6.4 %
Total	7.6 %	7.0 %	7.1 %	7.1 %

*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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	12 al 16 de septiembre				19 al 23 de septiembre				26 al 30 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	138	4830	4413	79	132	4087	3876	17	144	2996	3202
Intragruppo y off-shore***	0	0	1863	1779	0	55	2134	1729	0	0	1522	1049
Otros	138	23	1499	2001	132	24	779	1394	144	17	861	1128
Total	160	160	8192	8192	211	211	7000	7000	161	161	5379	5379

* 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.