

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2016

Fecha de Información: 07 de julio 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\$1915.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.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	297.1	328.2	126.8	173.2	133.5	56.0	68.0
15-35	539.7	511.2	299.4	206.1	19.5	141.3	192.3
36-60	160.8	13.1	0.0	112.0	13.1	48.8	0.0
61-90	2.2	18.2	10.0	0.0	8.2	2.2	0.0
91-180	14.9	81.7	65.0	0.0	6.7	4.9	10.0
>180	132.5	128.0	20.0	25.0	66.0	65.5	42.0
Total	1147.3	1080.5	521.2	516.3	247.1	318.7	312.3

* 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	7.3 %	8.0 %	4.7 %	6.5 %
15-35	7.3 %	7.4 %	7.2 %	7.3 %
36-60	-	-8.6 %	7.3 %	5.9 %
61-90	-	7.8 %	7.1 %	7.7 %
91-180	7.4 %	7.6 %	7.3 %	7.6 %
>180	7.2 %	7.2 %	7.2 %	7.2 %
Total	7.3 %	7.3 %	6.5 %	7.0 %

*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	4 al 8 de julio				11 al 15 de julio				18 al 22 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	110	3918	3517	20	159	3296	3160	20	159	2378	2766
Intragrupo y off-shore***	0	0	1671	1772	0	0	1574	1059	0	0	1601	781
Otros	110	23	837	1137	157	18	909	1560	159	20	467	899
Total	133	133	6426	6426	177	177	5780	5780	179	179	4446	4446

* 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.