

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2016

Fecha de Información: 11 de julio de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1405.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	238.9	230.2	68.4	113.8	55.9	19.0	106.0
15-35	582.3	284.2	88.5	192.9	93.7	287.4	102.0
36-60	2.2	27.9	0.0	0.0	27.9	2.2	0.0
61-90	12.8	42.9	16.9	0.0	26.0	12.8	0.0
91-180	16.9	55.9	0.0	1.3	55.9	15.6	0.0
>180	37.5	81.4	0.0	0.0	81.4	37.5	0.0
Total	890.5	722.5	173.7	308.0	340.7	374.5	208.0

* 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	
3-14	8.5 %	8.4 %	7.3 %	8.1 %
15-35	7.4 %	7.2 %	7.1 %	7.2 %
36-60	-	8.0 %	5.5 %	7.8 %
61-90	-	7.8 %	7.2 %	7.6 %
91-180	-	0.4 %	3.3 %	1.1 %
>180	-	1.2 %	6.7 %	2.9 %
Total	8.0 %	5.7 %	7.0 %	6.7 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de julio				18 al 22 de julio				25 al 29 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	151	3770	3482	24	158	2433	2890	16	138	2833	2614
Intragrupo y off-shore***	0	0	1622	1396	0	0	1661	781	0	0	1374	1217
Otros	149	19	1074	1587	158	24	501	924	138	16	791	1167
Total	171	171	6466	6466	182	182	4596	4596	154	154	4998	4998

* 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.