

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2016

Fecha de Información: 13 de julio 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\$2161.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.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	610.6	378.1	173.0	402.0	107.1	110.6	98.0
15-35	645.0	741.9	512.8	196.5	36.2	255.5	193.0
36-60	1.3	13.9	10.2	0.0	3.7	1.3	0.0
61-90	3.6	4.8	0.0	0.0	4.8	3.6	0.0
91-180	8.2	22.2	0.0	0.0	22.2	8.2	0.0
>180	3.9	19.4	10.0	0.0	9.4	3.9	0.0
Total	1272.7	1180.2	706.0	598.5	183.3	383.2	291.0

* 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	5.8 %	7.3 %	8.4 %	7.5 %
15-35	7.8 %	8.2 %	7.4 %	7.8 %
36-60	-	7.6 %	6.9 %	7.5 %
61-90	-	7.7 %	7.1 %	7.5 %
91-180	-	7.6 %	7.2 %	7.5 %
>180	-	7.2 %	6.7 %	7.1 %
Total	7.1 %	7.8 %	7.8 %	7.7 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	20	154	4494	3844	25	162	2616	3109	18	139	3118	2873
Intragruppo y off-shore***	0	0	1663	1853	0	0	1807	900	0	0	1513	1345
Otros	152	18	1227	1687	162	25	538	952	139	18	812	1224
Total	172	172	7383	7383	187	187	4961	4961	157	157	5443	5443

* 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.