

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2016

Fecha de Información: 14 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\$1577.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	240.3	336.0	124.5	105.0	129.0	52.8	82.5
15-35	559.1	353.1	231.4	118.9	29.8	348.3	91.9
36-60	0.2	7.3	0.0	0.0	7.3	0.2	0.0
61-90	13.2	18.4	0.0	13.1	18.4	0.1	0.0
91-180	4.3	39.6	30.0	0.0	9.6	4.3	0.0
>180	87.4	98.5	20.4	10.7	72.1	70.8	6.0
Total	904.5	852.9	406.3	247.6	266.2	476.5	180.4

* 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 %	7.4 %	8.2 %	7.7 %
15-35	5.9 %	7.3 %	7.5 %	7.2 %
36-60	-	7.8 %	6.9 %	7.8 %
61-90	-	8.2 %	7.3 %	8.0 %
91-180	-	7.7 %	7.2 %	7.6 %
>180	7.1 %	7.3 %	7.2 %	7.2 %
Total	6.8 %	7.4 %	7.6 %	7.4 %

* 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	153	4600	3973	25	161	2681	3205	20	138	3186	2985
Intragruppo y off-shore***	0	0	1663	1918	0	0	1879	940	0	0	1565	1345
Otros	151	18	1308	1681	161	25	549	964	138	20	849	1270
Total	171	171	7571	7571	186	186	5110	5110	158	158	5600	5600

* 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.