

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2016

Fecha de Información: 15 de julio de viernes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1587.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	480.4	391.7	161.5	307.1	105.2	48.3	125.0
15-35	316.6	426.9	369.3	95.5	4.3	167.9	53.3
36-60	2.3	15.8	13.5	0.0	2.3	2.3	0.0
61-90	12.4	15.7	0.0	0.0	5.7	2.4	10.0
91-180	4.6	27.6	0.0	0.0	27.6	4.6	0.0
>180	51.6	30.5	30.0	20.0	0.5	31.6	0.0
Total	867.9	908.2	574.3	422.6	145.7	257.1	188.3

* 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	
3-14	5.7 %	7.6 %	5.2 %	6.1 %
15-35	7.4 %	7.4 %	7.3 %	7.3 %
36-60	-	8.1 %	7.0 %	7.5 %
61-90	7.5 %	7.9 %	7.1 %	7.6 %
91-180	-	7.8 %	7.2 %	7.7 %
>180	-	7.3 %	7.0 %	7.1 %
Total	6.2 %	7.5 %	6.3 %	6.8 %

*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**	20	153	4600	3972	23	137	3067	3435	22	138	3277	3170
Intragrupo y off-shore***	0	0	1663	1918	0	0	1913	1227	0	0	1693	1365
Otros	151	18	1307	1681	137	23	667	985	138	22	859	1294
Total	171	171	7570	7570	160	160	5647	5647	160	160	5829	5829

* 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.