

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2016

Fecha de Información: 19 de julio de martes 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\$1660.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.5%.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	519.9	159.1	42.5	428.0	81.6	56.9	35.0
15-35	351.8	653.9	555.5	124.5	5.4	134.3	93.0
36-60	9.0	2.7	0.0	0.0	2.7	9.0	0.0
61-90	0.4	5.9	0.0	0.0	5.9	0.4	0.0
91-180	0.7	16.1	0.0	0.0	16.0	0.5	0.2
>180	18.0	60.6	50.0	8.0	0.6	0.0	10.0
Total	899.8	898.3	648.0	560.5	112.1	201.2	138.2

* 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 %	5.9 %	11.8 %	10.2 %
15-35	5.5 %	7.9 %	6.7 %	7.3 %
36-60	-	8.0 %	7.0 %	7.2 %
61-90	-	8.6 %	7.3 %	8.5 %
91-180	7.2 %	9.2 %	7.1 %	9.1 %
>180	7.0 %	7.4 %	-	7.3 %
Total	6.2 %	7.5 %	9.9 %	8.5 %

*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	18 al 22 de julio				25 al 29 de julio				1 al 5 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	132	3734	3663	23	134	3365	3284	11	80	2388	2144
Intragrupo y off-shore***	0	0	1944	1812	0	0	1763	1418	0	0	1116	728
Otros	132	23	793	996	134	23	903	1329	80	11	358	990
Total	155	155	6471	6471	157	157	6030	6030	91	91	3862	3862

* 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.