

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2016

Fecha de Información: 21 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\$1102.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	157.4	247.0	131.1	73.4	54.9	23.0	61.0
15-35	391.2	362.0	220.3	73.0	48.8	225.2	93.0
36-60	10.1	3.1	0.0	0.0	3.1	10.1	0.0
61-90	7.6	12.4	0.0	0.0	12.4	7.6	0.0
91-180	7.7	25.6	0.0	0.0	25.6	7.7	0.0
>180	16.3	16.6	0.0	5.0	16.6	11.3	0.0
Total	590.2	666.6	351.3	151.4	161.3	284.8	154.0

* 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	6.9 %	7.7 %	6.9 %	7.4 %
15-35	6.3 %	6.5 %	6.2 %	6.3 %
36-60	-	7.9 %	7.3 %	7.4 %
61-90	-	8.0 %	7.3 %	7.7 %
91-180	-	7.6 %	7.2 %	7.5 %
>180	-	6.7 %	6.7 %	6.7 %
Total	6.5 %	7.1 %	6.4 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	24	130	3792	3741	24	138	3437	3442	11	80	2405	2146
Intragruppo y off-shore***	0	0	1974	1851	0	0	1869	1443	0	0	1116	737
Otros	130	24	811	985	138	24	924	1345	80	11	361	998
Total	154	154	6577	6577	162	162	6230	6230	91	91	3882	3882

* 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.