

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2016

Fecha de Información: 22 de julio de viernes 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\$955.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	213.9	284.9	150.5	101.0	63.9	42.4	70.5
15-35	300.8	321.4	179.0	25.4	12.9	145.9	129.5
36-60	0.7	2.6	0.3	0.0	2.3	0.7	0.0
61-90	0.4	15.2	0.0	0.0	15.2	0.4	0.0
91-180	2.6	8.2	0.0	0.0	8.2	2.6	0.0
>180	1.4	3.3	0.0	0.0	3.3	1.4	0.0
Total	519.8	635.6	329.8	126.4	105.8	193.4	200.0

* 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	5.7 %	7.7 %	7.1 %	7.1 %
15-35	7.0 %	7.4 %	7.1 %	7.2 %
36-60	-	7.8 %	6.7 %	7.6 %
61-90	-	8.0 %	7.0 %	8.0 %
91-180	-	7.7 %	7.2 %	7.6 %
>180	-	7.4 %	6.5 %	7.1 %
Total	6.5 %	7.6 %	7.1 %	7.2 %

* 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	127	3792	3741	22	133	3599	3637	11	80	2455	2237
Intragruppo y off-shore***	0	0	1974	1851	0	0	1956	1539	0	0	1179	742
Otros	127	24	811	985	133	22	982	1361	80	11	369	1023
Total	151	151	6577	6577	155	155	6537	6537	91	91	4003	4003

* 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.