

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2016

Fecha de Información: 25 de julio de lunes 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\$1220.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	153.0	257.7	178.2	93.0	47.5	28.0	32.0
15-35	452.7	249.1	126.3	148.0	53.9	235.7	69.0
36-60	10.0	10.7	8.4	0.0	2.3	10.0	0.0
61-90	2.3	22.4	0.0	0.0	22.4	2.3	0.0
91-180	13.1	44.2	30.0	0.7	14.2	12.4	0.0
>180	80.0	41.6	0.0	6.7	26.6	58.3	15.0
Total	711.2	625.7	342.8	248.4	166.9	346.8	116.0

* 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	7.8 %	7.5 %	7.1 %	7.4 %
15-35	7.7 %	7.6 %	7.5 %	7.5 %
36-60	-	9.2 %	7.3 %	7.6 %
61-90	-	7.8 %	6.9 %	7.7 %
91-180	-	7.5 %	7.2 %	7.4 %
>180	7.2 %	7.4 %	7.1 %	7.2 %
Total	7.7 %	7.6 %	7.4 %	7.5 %

*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	25 al 29 de julio				1 al 5 de agosto				8 al 12 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	128	3659	3840	13	81	2529	2294	9	85	2965	2774
Intragruppo y off-shore***	0	0	2123	1593	0	0	1191	774	0	0	1329	835
Otros	128	22	1018	1367	81	13	381	1032	85	9	699	1385
Total	149	149	6800	6800	94	94	4101	4101	95	95	4993	4993

* 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.