

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1847.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	287.8	299.1	153.0	168.5	60.1	33.3	86.0
15-35	510.2	688.1	421.4	165.3	50.2	128.4	216.5
36-60	39.0	47.0	0.0	0.1	47.0	38.9	0.0
61-90	29.9	3.4	0.0	20.0	3.4	9.9	0.0
91-180	40.9	93.0	59.0	0.0	21.0	27.9	13.0
>180	64.6	60.3	20.0	25.0	40.3	39.6	0.0
Total	972.4	1190.9	653.4	378.9	222.0	278.0	315.5

* 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 %	7.1 %	5.1 %	6.4 %
15-35	7.8 %	8.1 %	7.6 %	7.9 %
36-60	-	7.7 %	7.3 %	7.5 %
61-90	-	8.6 %	7.3 %	7.5 %
91-180	7.3 %	7.5 %	6.7 %	7.2 %
>180	-	7.2 %	7.0 %	7.1 %
Total	7.8 %	7.7 %	6.6 %	7.4 %

*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	3863	3998	14	81	2610	2423	10	87	3024	2866
Intragruppo y off-shore***	0	0	2163	1732	0	0	1289	803	0	0	1373	835
Otros	128	22	1075	1372	81	14	386	1058	87	10	698	1393
Total	150	150	7102	7102	94	94	4285	4285	97	97	5095	5095

* 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.