

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2016

Fecha de Información: 27 de julio de miércoles 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\$2125.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.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	475.8	354.4	135.7	347.0	122.2	32.3	96.5
15-35	502.2	671.9	498.7	104.3	34.3	259.0	138.9
36-60	3.7	1.2	0.0	0.0	1.2	3.7	0.0
61-90	81.5	9.7	5.0	0.1	2.5	79.2	2.2
91-180	58.0	59.3	30.0	20.0	4.1	12.9	25.1
>180	82.9	87.6	25.0	20.0	62.6	62.9	0.0
Total	1204.2	1184.1	694.4	491.4	227.0	450.0	262.7

* 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	8.4 %	7.7 %	3.4 %	5.9 %
15-35	7.9 %	7.5 %	7.5 %	7.5 %
36-60	-	8.1 %	6.9 %	7.2 %
61-90	7.6 %	7.8 %	7.0 %	7.0 %
91-180	7.5 %	7.6 %	6.4 %	7.4 %
>180	-	7.2 %	7.2 %	7.2 %
Total	8.0 %	7.5 %	6.0 %	6.9 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	122	4177	4122	20	75	2713	2583	12	87	3097	2980
Intragruppo y off-shore***	0	0	2174	2045	0	0	1389	837	0	0	1435	835
Otros	122	22	1189	1373	75	20	400	1081	87	12	699	1417
Total	144	144	7540	7540	95	95	4501	4501	99	99	5231	5231

* 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.