

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2016

Fecha de Información: 28 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\$1704.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.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	329.7	233.5	40.5	160.0	48.0	24.7	145.0
15-35	623.6	766.7	406.1	199.4	164.6	228.2	196.0
36-60	7.5	13.4	0.1	0.0	13.3	7.5	0.0
61-90	8.9	17.4	0.1	0.0	17.3	8.9	0.0
91-180	5.2	6.2	0.4	0.3	5.8	4.9	0.0
>180	19.8	13.1	10.8	5.0	2.3	14.8	0.0
Total	994.7	1050.4	458.0	364.7	251.4	289.0	341.0

* 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	5.5 %	8.1 %	13.9 %	8.6 %
15-35	7.7 %	7.9 %	6.7 %	7.4 %
36-60	-	8.6 %	7.2 %	8.1 %
61-90	-	8.0 %	6.6 %	7.5 %
91-180	-	7.7 %	6.4 %	7.1 %
>180	-	6.9 %	6.8 %	6.8 %
Total	-	7.9 %	7.9 %	7.7 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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**	21	123	4374	4157	22	76	2744	2632	12	88	3198	3062
Intragruppo y off-shore***	0	0	2184	2186	0	0	1396	856	0	0	1459	835
Otros	123	21	1179	1374	76	22	442	1093	88	12	708	1427
Total	143	143	7737	7717	99	99	4582	4582	100	100	5364	5324

* 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.

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.