

Fecha de Publicación: 7 de julio de 2016

Fecha de Información: 05 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\$1695.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	392.3	325.9	130.0	271.0	115.9	41.3	80.0
15-35	417.9	524.5	247.1	41.3	95.4	194.6	182.0
36-60	23.3	31.6	0.0	0.0	31.6	23.3	0.0
61-90	2.2	32.7	0.0	0.0	32.7	2.2	0.0
91-180	2.2	32.2	0.0	0.0	32.2	2.2	0.0
>180	97.3	85.7	0.0	20.0	75.7	67.3	10.0
Total	935.2	1032.5	377.1	332.3	383.5	331.0	272.0

* 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	6.1 %	7.7 %	5.6 %	6.5 %
15-35	7.6 %	7.5 %	7.3 %	7.4 %
36-60	-	7.6 %	7.5 %	7.6 %
61-90	-	7.7 %	7.1 %	7.6 %
91-180	-	7.4 %	7.2 %	7.4 %
>180	7.2 %	7.3 %	7.2 %	7.3 %
Total	7.1 %	7.5 %	6.5 %	7.1 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de julio				11 al 15 de julio				18 al 22 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	108	3567	3348	19	161	3107	2846	19	159	2263	2702
Intragruppo y off-shore***	0	0	1636	1507	0	0	1399	980	0	0	1579	751
Otros	108	23	751	1099	159	17	829	1510	159	19	452	841
Total	131	131	5954	5954	179	179	5336	5336	178	178	4294	4294

* 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.