

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2016

Fecha de Información: 06 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\$1346.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	313.5	191.7	105.8	202.0	46.9	72.5	39.0
15-35	336.8	469.5	310.0	73.0	39.7	144.1	119.8
36-60	27.5	30.2	0.0	0.0	30.2	27.5	0.0
61-90	0.9	2.9	0.0	0.0	2.9	0.9	0.0
91-180	9.5	5.4	0.0	0.0	5.4	9.5	0.0
>180	86.4	30.6	20.0	0.0	10.6	86.4	0.0
Total	774.7	730.3	435.8	275.0	135.8	341.0	158.8

* 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	7.6 %	7.4 %	6.5 %	6.9 %
15-35	7.0 %	7.6 %	7.3 %	7.4 %
36-60	-	7.8 %	6.9 %	7.3 %
61-90	-	8.0 %	6.6 %	7.7 %
91-180	-	8.0 %	7.3 %	7.5 %
>180	-	7.4 %	6.9 %	7.1 %
Total	7.1 %	7.6 %	6.9 %	7.2 %

*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	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	106	3815	3457	20	166	3170	2912	19	158	2302	2739
Intragruppo y off-shore***	0	0	1671	1678	0	0	1457	1011	0	0	1591	751
Otros	106	23	786	1136	164	18	838	1543	158	19	455	858
Total	130	130	6272	6272	184	184	5465	5465	177	177	4348	4348

* 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.