Fecha de Publicación: 14 de julio de 2016

Fecha de Información: 12 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$1532.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.[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	463.7	359.0	112.0	273.5	110.5	53.7	136.5
15-35	519.5	437.0	165.2	205.5	99.3	141.5	172.5
36-60	3.4	6.2	0.0	0.0	6.2	3.4	0.0
61-90	0.3	7.4	0.0	0.0	7.4	0.3	0.0
91-180	1.8	15.6	2.0	0.0	13.6	1.8	0.0
>180	0.3	26.8	20.0	0.0	6.8	0.3	0.0
Total	**989.0**	**852.0**	**299.2**	**479.0**	**243.7**	**201.0**	**309.0**

* 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	8.1 %	8.4 %	5.7 %	7.5 %
15-35	7.6 %	7.1 %	8.1 %	7.6 %
36-60	-	7.9 %	7.3 %	7.7 %
61-90	-	7.7 %	7.2 %	7.7 %
91-180	-	7.5 %	7.1 %	7.5 %
>180	-	7.2 %	6.3 %	7.2 %
Total	7.8 %	7.7 %	7.2 %	7.6 %

*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de julio				18 al 22 de julio				25 al 29 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	152	3992	3639	24	162	2552	2998	16	139	3008	2763
Intragrupo y off-shore***	0	0	1627	1492	0	0	1728	877	0	0	1443	1309
Otros	150	19	1131	1619	162	24	531	936	139	16	809	1189
Total	**171**	**171**	**6750**	**6750**	**186**	**186**	**4811**	**4811**	**155**	**155**	**5261**	**5261**

* 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.