

Fecha de Publicación: 2 de agosto de 2016

Fecha de Información: 29 de julio de viernes 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\$1302.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	157.0	375.9	102.3	9.0	183.7	58.0	90.0
15-35	504.5	356.5	105.3	142.0	143.4	254.7	107.8
36-60	8.9	4.1	0.0	0.0	4.1	8.9	0.0
61-90	39.7	17.8	0.0	0.0	12.8	34.7	5.0
91-180	7.3	17.8	0.0	0.0	17.8	7.3	0.0
>180	11.7	4.5	0.0	0.0	4.5	11.7	0.0
Total	729.1	776.6	207.5	151.0	366.3	375.3	202.8

* 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	7.8 %	8.0 %	6.9 %	7.8 %
15-35	6.6 %	7.8 %	7.2 %	7.3 %
36-60	-	8.3 %	8.5 %	8.5 %
61-90	7.8 %	7.7 %	7.1 %	7.3 %
91-180	-	7.8 %	6.9 %	7.5 %
>180	-	7.8 %	6.3 %	6.7 %
Total	7.2 %	7.9 %	7.1 %	7.5 %

*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

Sector	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**	20	124	4374	4158	21	74	2838	2905	15	91	3246	3169
Intragruppo y off-shore***	0	0	2184	2186	0	0	1469	861	0	0	1487	839
Otros	123	20	1180	1374	74	21	591	1132	91	15	746	1432
Total	144	144	7738	7718	95	95	4898	4898	106	106	5480	5440

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