

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2016

Fecha de Información: 15 de junio 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\$1734.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.8%.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	443.4	358.1	153.4	276.3	155.1	117.5	49.6
15-35	290.0	471.3	382.6	109.5	38.2	129.9	50.6
36-60	1.5	12.9	0.0	0.0	12.9	1.5	0.0
61-90	52.6	40.9	0.0	0.0	40.9	52.6	0.0
91-180	0.9	27.4	20.0	0.0	7.4	0.9	0.0
>180	68.9	76.8	0.0	0.0	66.8	58.9	10.0
Total	857.2	987.5	556.0	385.8	321.3	361.2	110.2

* 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	8.4 %	8.3 %	5.9 %	7.0 %
15-35	8.6 %	9.2 %	7.7 %	8.6 %
36-60	-	8.9 %	7.1 %	8.7 %
61-90	-	8.2 %	7.8 %	8.0 %
91-180	-	7.9 %	7.2 %	7.9 %
>180	6.9 %	7.0 %	6.9 %	7.0 %
Total	8.3 %	8.6 %	6.7 %	7.8 %

*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	13 al 17 de junio				20 al 24 de junio				27 de jun. al 1 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	56	137	4006	3885	22	209	2485	3480	12	147	2736	2686
Intragruppo y off-shore***	0	0	2333	1878	0	0	1995	850	0	0	1406	608
Otros	127	46	788	1363	209	22	817	966	147	12	644	1491
Total	182	182	7126	7126	231	231	5296	5296	159	159	4785	4785

* 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.