

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2016

Fecha de Información: 16 de junio de jueves 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\$1807.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.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	351.3	382.1	169.0	164.7	130.1	103.7	83.0
15-35	557.2	519.3	184.5	138.7	73.8	157.5	261.0
36-60	4.6	9.4	0.0	0.2	9.4	4.4	0.0
61-90	153.5	62.2	5.0	70.0	31.2	57.5	26.0
91-180	7.5	8.6	0.0	5.0	8.6	2.5	0.0
>180	50.9	70.3	20.0	0.0	50.3	50.9	0.0
Total	1125.1	1051.9	378.5	378.6	303.4	376.6	370.0

* 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	8.6 %	7.8 %	7.0 %	7.6 %
15-35	8.5 %	8.5 %	8.3 %	8.5 %
36-60	-	9.9 %	7.3 %	9.1 %
61-90	8.0 %	8.3 %	7.8 %	7.9 %
91-180	-	7.9 %	7.4 %	7.8 %
>180	-	7.3 %	7.3 %	7.3 %
Total	8.5 %	8.1 %	7.6 %	8.0 %

*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**	55	137	4099	4037	25	212	2671	3638	15	148	2803	2755
Intragruppo y off-shore***	0	0	2399	1925	0	0	2077	951	0	0	1427	625
Otros	127	45	834	1369	212	25	860	1018	148	15	682	1531
Total	183	183	7331	7331	236	236	5607	5607	163	163	4911	4911

* 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.