

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2016

Fecha de Información: 20 de junio de lunes 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\$1225.2 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	246.4	235.6	74.5	125.0	71.6	31.9	89.5
15-35	421.2	267.7	152.2	179.5	37.6	163.7	78.0
36-60	34.0	11.0	0.0	0.0	11.0	34.0	0.0
61-90	3.0	16.1	0.0	0.0	16.1	3.0	0.0
91-180	7.0	27.2	0.0	6.5	27.2	0.5	0.0
>180	45.2	78.2	40.0	43.1	38.2	2.1	0.0
Total	756.8	635.9	266.7	354.1	201.7	235.2	167.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.0 %	7.1 %	7.7 %	7.1 %
15-35	8.4 %	7.6 %	7.6 %	7.7 %
36-60	-	8.5 %	8.2 %	8.3 %
61-90	-	8.3 %	7.8 %	8.2 %
91-180	-	7.9 %	6.4 %	7.6 %
>180	-	7.8 %	7.5 %	7.7 %
Total	7.1 %	7.6 %	7.7 %	7.5 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	20 al 24 de junio				27 de jun. al 1 de julio				4 al 8 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	257	3172	3958	19	142	2911	2894	8	73	2260	2382
Intragruppo y off-shore***	0	0	2180	1262	0	0	1513	675	0	0	1342	867
Otros	257	29	923	1056	142	19	709	1564	73	8	430	784
Total	286	286	6275	6275	161	161	5133	5133	81	81	4032	4032

* 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.