

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2016

Fecha de Información: 21 de junio 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\$1108.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.2%.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	324.6	106.5	7.0	216.8	16.5	24.8	83.0
15-35	168.3	348.9	279.8	63.0	15.6	51.8	53.5
36-60	24.4	35.1	0.0	21.2	35.1	3.2	0.0
61-90	2.2	7.0	0.0	0.0	7.0	2.2	0.0
91-180	21.8	21.0	0.0	0.0	21.0	21.8	0.0
>180	113.2	97.5	10.0	25.0	62.5	63.2	25.0
Total	654.4	616.0	296.8	326.0	157.7	166.9	161.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8.7 %	8.2 %	8.6 %	8.6 %
15-35	8.4 %	8.3 %	8.1 %	8.3 %
36-60	-	8.6 %	7.8 %	8.5 %
61-90	-	8.4 %	7.7 %	8.2 %
91-180	-	7.8 %	7.7 %	7.8 %
>180	7.2 %	7.4 %	7.2 %	7.3 %
Total	8.4 %	8.2 %	8.1 %	8.2 %

*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 intragrupo.

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	248	3455	4031	22	143	2954	2936	10	81	2270	2383
Intragrupoy off-shore***	0	0	2185	1475	0	0	1515	680	0	0	1343	872
Otros	247	29	935	1069	143	22	724	1577	81	10	430	788
Total	276	276	6575	6575	165	165	5193	5193	91	91	4043	4043

* 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.