

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2016

Fecha de Información: 22 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\$2162.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.4%.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	842.2	207.8	33.8	649.4	99.9	118.8	74.0
15-35	286.2	719.9	563.9	143.0	33.7	20.9	122.3
36-60	14.9	50.8	13.0	0.0	37.8	14.9	0.0
61-90	2.4	51.7	34.0	0.0	17.7	2.4	0.0
91-180	3.7	38.0	0.0	0.0	37.9	3.6	0.1
>180	70.4	74.7	0.0	0.0	70.7	66.4	4.0
Total	1219.8	1142.8	644.7	792.3	297.8	227.1	200.4

* 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	8.2 %	8.4 %	6.7 %	7.2 %
15-35	8.3 %	11.0 %	6.5 %	9.7 %
36-60	-	8.3 %	7.7 %	8.2 %
61-90	-	8.1 %	6.8 %	8.0 %
91-180	8.1 %	8.0 %	7.7 %	8.0 %
>180	7.1 %	7.4 %	7.3 %	7.4 %
Total	8.3 %	9.8 %	6.7 %	8.4 %

*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	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	245	4065	4074	22	155	3009	2967	10	98	2509	2554
Intragruppo y off-shore***	0	0	2189	2046	0	0	1543	717	0	0	1370	931
Otros	245	29	944	1078	155	22	726	1594	98	10	497	892
Total	275	275	7198	7198	177	177	5278	5278	108	108	4376	4376

* 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.