

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2016

Fecha de Información: 23 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\$1406.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.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	372.3	159.0	104.6	291.5	39.6	66.0	14.8
15-35	431.7	328.0	127.9	160.0	99.1	170.7	101.0
36-60	40.1	18.8	0.0	0.0	17.8	39.1	1.0
61-90	17.1	32.3	0.0	0.0	23.6	8.3	8.8
91-180	60.4	50.4	0.1	0.0	36.4	46.4	14.0
>180	3.1	34.5	22.0	0.0	10.6	1.2	1.9
Total	924.7	623.1	254.6	451.5	227.0	331.8	141.5

* 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	7.3 %	8.5 %	7.8 %	8.0 %
15-35	7.7 %	7.8 %	7.6 %	7.7 %
36-60	7.6 %	10.0 %	7.4 %	8.2 %
61-90	7.8 %	10.7 %	7.7 %	9.5 %
91-180	7.7 %	8.1 %	7.6 %	7.8 %
>180	7.5 %	7.4 %	6.8 %	7.3 %
Total	7.7 %	8.2 %	7.7 %	7.9 %

*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**	30	249	4110	4079	22	156	3172	3009	10	98	2693	2681
Intragruppo y off-shore***	0	0	2194	2091	0	0	1553	827	0	0	1465	1067
Otros	249	30	945	1078	156	22	752	1640	98	10	507	917
Total	280	280	7248	7248	177	177	5477	5477	109	109	4664	4664

* 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.