

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2016

Fecha de Información: 24 de junio de viernes 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\$919.6 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	181.8	180.3	37.5	99.9	105.2	44.4	37.6
15-35	336.3	221.3	119.0	182.5	65.3	116.8	37.0
36-60	1.7	11.7	0.0	0.0	11.7	1.7	0.0
61-90	7.6	8.0	0.0	1.7	8.0	5.9	0.0
91-180	7.0	18.0	0.0	0.0	18.0	7.0	0.0
>180	16.6	8.9	0.0	0.0	3.9	11.6	5.0
Total	551.0	448.2	156.5	284.0	212.1	187.4	79.6

* 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	8.0 %	8.1 %	3.7 %	6.3 %
15-35	7.2 %	8.1 %	8.3 %	8.1 %
36-60	-	8.6 %	7.0 %	8.4 %
61-90	-	8.7 %	7.3 %	8.0 %
91-180	-	8.5 %	7.5 %	8.2 %
>180	7.1 %	7.7 %	8.7 %	8.1 %
Total	7.6 %	8.1 %	6.9 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	116	4110	4079	23	285	3346	3184	11	99	2700	2691
Intragrupa y off-shore***	0	0	2194	2091	0	0	1582	925	0	0	1473	1069
Otros	116	30	944	1078	285	23	859	1678	99	11	509	921
Total	146	146	7248	7248	308	308	5787	5787	110	110	4682	4682

* 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.