

Fecha de Publicación: 29 de junio de 2016

Fecha de Información: 27 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\$1194.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.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	179.3	214.2	129.4	80.8	38.7	52.4	46.1
15-35	386.8	289.5	98.5	97.0	87.0	185.8	104.0
36-60	67.8	3.1	0.0	30.0	3.1	37.8	0.0
61-90	40.2	25.1	0.0	0.0	25.1	40.2	0.0
91-180	57.3	74.9	20.0	5.0	24.6	22.0	30.2
>180	35.5	10.8	0.0	20.0	0.8	5.5	10.0
Total	767.0	617.7	247.9	232.8	179.4	343.8	190.3

* 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	7.9 %	7.9 %	7.4 %	7.7 %
15-35	8.0 %	7.1 %	7.7 %	7.5 %
36-60	-	8.6 %	7.5 %	7.5 %
61-90	-	8.3 %	7.6 %	7.8 %
91-180	7.8 %	7.8 %	7.5 %	7.8 %
>180	7.3 %	7.8 %	7.1 %	7.2 %
Total	7.9 %	7.6 %	7.6 %	7.6 %

*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	27 de jun. al 1 de julio				4 al 8 de julio				11 al 15 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	288	3444	3296	13	99	2739	2734	12	159	2530	2414
Intragrupoy off-shore***	0	0	1639	967	0	0	1491	1070	0	0	1216	713
Otros	288	22	890	1709	99	13	513	939	157	10	734	1353
Total	310	310	5972	5972	113	113	4743	4743	169	169	4481	4481

* 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.