

Fecha de Publicación: 30 de junio de 2016

Fecha de Información: 28 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\$2727.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.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	566.1	437.9	201.3	331.0	176.6	175.0	60.0
15-35	691.5	561.1	418.3	197.5	68.7	420.0	74.0
36-60	119.6	195.7	60.0	0.0	75.7	59.6	60.0
61-90	209.2	11.2	0.0	51.9	11.2	157.3	0.0
91-180	6.1	75.4	23.4	0.0	52.1	6.1	0.0
>180	14.4	33.4	0.0	10.0	33.4	4.4	0.0
Total	1606.9	1314.6	703.0	590.5	417.6	822.4	194.0

* 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	7.7 %	8.1 %	6.6 %	7.2 %
15-35	7.7 %	8.0 %	7.6 %	7.8 %
36-60	7.9 %	8.0 %	6.6 %	7.7 %
61-90	-	9.4 %	7.3 %	7.4 %
91-180	-	8.5 %	7.1 %	8.4 %
>180	-	7.9 %	7.4 %	7.7 %
Total	7.7 %	8.1 %	7.1 %	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	289	3753	3607	17	101	2953	2863	14	159	2637	2453
Intragruppo y off-shore***	0	0	1805	1233	0	0	1525	1135	0	0	1250	723
Otros	289	22	1014	1732	101	17	567	1047	157	12	739	1450
Total	310	310	6572	6572	118	118	5045	5045	170	170	4626	4626

* 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.