

Fecha de Publicación: 1 de julio de 2016

Fecha de Información: 29 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\$2110.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.8%.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	681.0	241.7	20.8	507.0	76.9	30.0	144.0
15-35	603.2	686.2	426.1	248.3	125.9	220.7	134.2
36-60	31.5	51.8	0.1	0.0	41.7	21.5	10.0
61-90	3.2	16.0	0.0	0.0	16.0	3.2	0.0
91-180	20.8	42.8	0.0	1.7	42.8	19.1	0.0
>180	10.9	19.4	6.6	0.0	2.8	0.9	10.0
Total	1350.6	1058.0	453.6	756.9	306.2	295.5	298.2

* 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	5.4 %	7.8 %	6.5 %	6.4 %
15-35	7.5 %	8.1 %	9.4 %	8.5 %
36-60	7.7 %	8.0 %	7.5 %	7.8 %
61-90	-	8.3 %	7.4 %	8.2 %
91-180	-	8.1 %	6.9 %	7.7 %
>180	7.1 %	7.4 %	6.7 %	7.2 %
Total	6.5 %	8.0 %	8.0 %	7.8 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	290	4126	3648	17	107	3061	2957	14	160	2872	2586
Intragrupa y off-shore***	0	0	1823	1582	0	0	1528	1168	0	0	1259	847
Otros	290	22	1007	1726	107	17	599	1063	158	12	773	1470
Total	312	312	6956	6956	124	124	5189	5189	172	172	4903	4903

* 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.

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.