

Fecha de Publicación: 5 de julio de 2016

Fecha de Información: 30 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\$1284.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	231.1	159.5	11.0	114.0	73.5	42.1	75.0
15-35	438.3	401.9	125.6	124.0	99.3	137.3	177.0
36-60	51.3	64.1	16.5	18.5	19.1	4.3	28.5
61-90	7.6	53.0	20.0	0.0	33.0	7.6	0.0
91-180	34.9	23.3	0.0	20.0	20.2	11.8	3.1
>180	59.8	59.9	20.0	0.0	23.4	43.3	16.5
Total	823.0	761.7	193.1	276.5	268.5	246.4	300.1

* 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	7.5 %	6.9 %	4.4 %	5.8 %
15-35	7.7 %	9.2 %	7.3 %	8.1 %
36-60	7.4 %	7.8 %	7.4 %	7.6 %
61-90	-	7.7 %	7.0 %	7.6 %
91-180	7.6 %	8.0 %	7.5 %	7.7 %
>180	7.4 %	7.3 %	7.0 %	7.2 %
Total	7.6 %	8.2 %	6.4 %	7.4 %

*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	293	4164	3662	19	110	3232	3056	14	159	2900	2626
Intragruppo y off-shore***	0	0	1831	1596	0	0	1530	1268	0	0	1260	847
Otros	293	22	1006	1743	110	19	651	1088	157	12	790	1477
Total	315	315	7001	7001	129	129	5413	5413	171	171	4950	4950

* 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.