

Fecha de Publicación: 2 de junio de 2016

Fecha de Información: 31 de mayo 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\$1500.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	343.3	357.6	263.5	248.3	24.3	25.3	69.8
15-35	538.0	294.9	141.0	140.1	48.4	292.4	105.5
36-60	10.5	48.5	0.5	0.0	43.0	5.5	5.0
61-90	6.6	15.4	0.0	0.0	15.4	6.6	0.0
91-180	22.9	18.7	0.0	22.4	18.7	0.5	0.0
>180	16.3	13.9	0.0	8.9	7.9	1.4	6.0
Total	937.5	748.9	405.0	419.7	157.7	331.6	186.3

* 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	7.5 %	8.0 %	7.8 %	7.9 %
15-35	7.9 %	7.9 %	8.4 %	8.2 %
36-60	7.6 %	8.0 %	6.8 %	7.8 %
61-90	-	7.5 %	5.9 %	7.0 %
91-180	-	7.5 %	6.9 %	7.2 %
>180	6.0 %	7.3 %	6.4 %	6.7 %
Total	7.7 %	7.9 %	8.2 %	8.0 %

*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	30 de may. al 3 de junio				6 al 10 de junio				13 al 17 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	90	3331	3233	12	75	2848	2460	36	126	2550	2313
Intragrupo y off-shore***	0	0	1965	1376	0	0	1183	1028	0	0	1399	982
Otros	90	25	529	1211	75	12	644	1187	125	36	535	1190
Total	115	115	5825	5820	86	86	4675	4675	162	162	4484	4484

* 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.