

Fecha de Publicación: 3 de junio de 2016

Fecha de Información: 01 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\$1595.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	310.4	267.8	146.6	206.6	65.7	48.3	55.5
15-35	518.7	537.1	318.6	93.6	41.0	247.6	177.5
36-60	27.2	21.4	0.0	0.0	10.8	16.5	10.7
61-90	22.2	23.7	0.0	10.0	11.9	0.5	11.7
91-180	39.9	38.8	15.0	20.0	22.5	18.6	1.3
>180	42.9	42.4	0.0	0.0	2.4	2.9	40.0
Total	961.3	931.2	480.2	330.2	154.3	334.4	296.7

* 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	8.4 %	7.7 %	5.0 %	6.7 %
15-35	8.0 %	8.3 %	7.8 %	8.0 %
36-60	7.3 %	7.9 %	7.5 %	7.5 %
61-90	7.9 %	7.7 %	6.8 %	7.8 %
91-180	7.5 %	7.2 %	7.0 %	7.1 %
>180	6.4 %	7.2 %	4.6 %	6.3 %
Total	7.8 %	8.0 %	6.8 %	7.5 %

*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: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	87	3490	3287	12	74	2939	2576	36	126	2625	2422
Intragrupo y off-shore***	0	0	1993	1521	0	0	1237	1062	0	0	1465	1009
Otros	87	25	542	1213	74	12	693	1231	126	36	546	1206
Total	112	112	6025	6020	86	86	4868	4868	162	162	4637	4637

* 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.