

Fecha de Publicación: 3 de junio de 2016

Fecha de Información: 01 de junio de miércoles¹

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 | |
| 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/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.