

Fecha de Publicación: 7 de junio de 2016

Fecha de Información: 02 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\$1300.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.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	202.3	315.8	158.5	128.0	94.4	11.3	63.0
15-35	327.7	377.4	259.5	146.5	34.4	97.7	83.5
36-60	89.2	35.0	22.5	85.0	12.5	4.2	0.0
61-90	9.3	43.3	28.0	0.0	15.3	9.3	0.0
91-180	22.1	21.1	0.0	20.5	21.1	1.6	0.0
>180	1.1	2.4	0.0	0.1	2.4	1.0	0.0
Total	651.7	795.0	468.5	380.1	180.0	125.1	146.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.7 %	7.8 %	8.0 %	7.8 %
15-35	8.0 %	7.4 %	9.3 %	8.4 %
36-60	-	8.2 %	6.3 %	6.8 %
61-90	-	7.7 %	7.1 %	7.6 %
91-180	-	7.4 %	6.7 %	7.3 %
>180	-	6.9 %	6.1 %	6.6 %
Total	7.8 %	7.6 %	8.3 %	7.9 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

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**	24	88	3591	3305	13	75	2965	2678	36	127	2704	2622
Intragruppo y off-shore***	0	0	2007	1611	0	0	1281	1062	0	0	1575	1047
Otros	88	24	538	1215	75	13	736	1241	126	36	597	1207
Total	113	113	6136	6131	88	88	4981	4981	163	163	4876	4876

* 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.