

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2016

Fecha de Información: 08 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\$2001.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	389.0	267.4	155.5	307.2	57.1	27.1	54.8
15-35	513.2	602.5	374.0	112.0	76.5	249.2	152.0
36-60	114.5	16.2	1.0	0.0	15.2	114.5	0.0
61-90	47.5	66.1	0.0	10.0	66.0	37.5	0.0
91-180	92.6	51.0	0.0	91.6	51.0	1.0	0.0
>180	37.4	10.8	0.0	35.0	10.8	2.4	0.0
Total	1194.2	1014.0	530.5	555.8	276.6	431.7	206.8

* 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	7.5 %	8.9 %	6.1 %	7.3 %
15-35	8.1 %	7.9 %	7.2 %	7.6 %
36-60	-	8.2 %	7.4 %	7.5 %
61-90	-	7.8 %	7.5 %	7.7 %
91-180	-	7.7 %	7.4 %	7.5 %
>180	-	8.1 %	7.3 %	7.5 %
Total	7.9 %	8.1 %	7.0 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	6 al 10 de junio				13 al 17 de junio				20 al 24 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	77	3454	3131	40	120	3044	3070	15	209	2009	2929
Intragruppo y off-shore***	0	0	1546	1342	0	0	1816	1168	0	0	1661	569
Otros	76	17	757	1283	120	40	700	1322	209	15	686	858
Total	94	94	5756	5756	160	160	5559	5559	224	224	4357	4357

* 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.