

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2016

Fecha de Información: 14 de junio 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\$1455.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.2%.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 | 272.7 | 262.0 | 141.0 | 218.0 | 84.0 | 17.7 | 37.0 |
| 15-35 | 366.9 | 472.8 | 334.0 | 110.3 | 19.8 | 137.6 | 119.0 |
| 36-60 | 55.1 | 42.5 | 25.0 | 1.5 | 17.5 | 53.6 | 0.0 |
| 61-90 | 16.9 | 14.5 | 0.0 | 15.5 | 14.5 | 1.4 | 0.0 |
| 91-180 | 55.8 | 37.7 | 0.0 | 32.0 | 37.7 | 23.8 | 0.0 |
| >180 | 2.1 | 12.0 | 0.0 | 0.0 | 12.0 | 2.1 | 0.0 |
| Total | 769.5 | 841.5 | 500.0 | 377.3 | 185.5 | 236.2 | 156.0 |

* 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 | 9.6 % | 8.2 % | 9.3 % | 8.8 % |
| 15-35 | 8.2 % | 8.2 % | 7.9 % | 8.1 % |
| 36-60 | - | 8.0 % | 7.5 % | 7.7 % |
| 61-90 | - | 8.5 % | 7.2 % | 7.8 % |
| 91-180 | - | 7.5 % | 7.4 % | 7.4 % |
| >180 | - | 7.4 % | 6.9 % | 7.3 % |
| Total | 8.5 % | 8.1 % | 8.3 % | 8.2 % |

*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 | 13 al 17 de junio | | | | 20 al 24 de junio | | | | 27 de jun. al 1 de julio | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 56 | 124 | 3784 | 3832 | 21 | 211 | 2354 | 3294 | 12 | 147 | 2644 | 2557 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2284 | 1664 | 0 | 0 | 1914 | 792 | 0 | 0 | 1365 | 603 |
| Otros | 114 | 46 | 790 | 1361 | 211 | 21 | 748 | 930 | 147 | 12 | 562 | 1410 |
| Total | 170 | 170 | 6858 | 6858 | 232 | 232 | 5017 | 5017 | 159 | 159 | 4570 | 4570 |

* 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.