

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2016

Fecha de Información: 01 de julio de viernes 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\$925.1 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 | 196.4 | 219.7 | 115.1 | 100.3 | 37.6 | 29.1 | 67.0 |
| 15-35 | 313.9 | 164.8 | 80.6 | 173.5 | 34.2 | 90.4 | 50.0 |
| 36-60 | 3.6 | 18.6 | 0.0 | 0.0 | 18.6 | 3.6 | 0.0 |
| 61-90 | 0.6 | 12.5 | 0.0 | 0.0 | 12.5 | 0.6 | 0.0 |
| 91-180 | 5.4 | 14.3 | 0.1 | 0.0 | 14.2 | 5.4 | 0.0 |
| >180 | 67.9 | 80.4 | 10.0 | 10.0 | 14.4 | 1.9 | 56.0 |
| Total | 587.9 | 510.2 | 205.8 | 283.8 | 131.4 | 131.1 | 173.0 |

* 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 | 7.5 % | 8.5 % | 7.0 % | 7.9 % |
| 15-35 | 7.5 % | 7.0 % | 7.3 % | 7.3 % |
| 36-60 | - | 8.7 % | 6.7 % | 8.4 % |
| 61-90 | - | 8.1 % | 6.9 % | 8.1 % |
| 91-180 | - | 7.8 % | 7.3 % | 7.6 % |
| >180 | 6.9 % | 7.4 % | 7.0 % | 7.0 % |
| Total | 7.3 % | 7.9 % | 7.2 % | 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 27 de jun. al 1 de julio | | | | 4 al 8 de julio | | | | 11 al 15 de julio | | | |
|-----------------------------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 291 | 4164 | 3664 | 19 | 109 | 3297 | 3187 | 16 | 162 | 3031 | 2710 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1831 | 1596 | 0 | 0 | 1620 | 1292 | 0 | 0 | 1285 | 924 |
| Otros | 291 | 22 | 1008 | 1743 | 109 | 19 | 666 | 1103 | 160 | 14 | 808 | 1490 |
| Total | 313 | 313 | 7003 | 7003 | 129 | 129 | 5582 | 5582 | 175 | 175 | 5124 | 5124 |

* 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.