Fecha de Publicación: 1 de junio de 2016

Fecha de Información: 27 de mayo 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$1357.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.[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	193.3	210.6	83.5	79.7	72.1	58.7	55.0
15-35	396.1	418.9	274.7	121.0	105.7	236.6	38.5
36-60	96.1	14.3	1.7	95.0	12.6	1.1	0.0
61-90	30.6	49.1	40.0	30.0	9.1	0.6	0.0
91-180	1.3	19.0	0.0	0.0	19.0	1.3	0.0
>180	20.8	15.8	0.0	0.8	0.8	5.0	15.0
Total	**738.2**	**727.7**	**399.9**	**326.5**	**219.3**	**303.2**	**108.5**

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.6 %	7.5 %	6.0 %	7.0 %
15-35	7.6 %	6.2 %	7.4 %	6.8 %
36-60	-	8.2 %	7.3 %	7.5 %
61-90	-	7.4 %	7.5 %	7.5 %
91-180	-	7.5 %	6.7 %	7.5 %
>180	6.5 %	7.4 %	6.5 %	6.5 %
Total	7.4 %	6.7 %	7.1 %	6.9 %

*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: ((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	23 al 27 de mayo				30 de may. al 3 de junio				6 al 10 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	120	4377	4090	25	99	3104	2978	10	78	2820	2397
Intragrupo y off-shore***	0	0	1813	1534	0	0	1765	1205	0	0	1139	1026
Otros	119	41	1144	1710	99	25	524	1206	78	10	634	1170
Total	**160**	**160**	**7334**	**7334**	**124**	**124**	**5393**	**5388**	**88**	**88**	**4593**	**4593**

* 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.