Fecha de Publicación: 9 de junio de 2016

Fecha de Información: 07 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$1822.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.[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	393.9	411.6	207.9	134.0	66.2	122.4	137.5
15-35	599.5	435.8	229.5	221.5	13.8	185.5	192.5
36-60	60.6	25.8	7.2	56.0	17.4	3.4	1.2
61-90	37.3	45.8	0.0	0.0	45.8	37.3	0.0
91-180	32.0	57.3	0.0	30.6	57.3	1.4	0.0
>180	30.0	24.4	0.0	30.0	24.4	0.0	0.0
Total	**1153.2**	**1000.7**	**444.6**	**472.1**	**224.9**	**349.9**	**331.2**

* 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	8.1 %	8.4 %	8.4 %	8.3 %
15-35	8.0 %	8.2 %	6.9 %	7.6 %
36-60	7.9 %	8.0 %	8.1 %	8.1 %
61-90	-	8.1 %	7.3 %	7.7 %
91-180	-	7.7 %	7.5 %	7.6 %
>180	-	7.2 %	7.4 %	7.3 %
Total	8.0 %	8.2 %	7.6 %	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: ((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	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**	14	75	3240	3106	37	134	2921	2837	15	189	1945	2863
Intragrupo y off-shore***	0	0	1541	1141	0	0	1665	1105	0	0	1612	525
Otros	75	14	742	1275	134	37	667	1311	189	15	676	845
Total	**89**	**89**	**5522**	**5522**	**171**	**171**	**5253**	**5253**	**204**	**204**	**4233**	**4233**

* 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.