Fecha de Publicación: 13 de junio de 2016

Fecha de Información: 09 de junio de jueves [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$1356.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.8%.[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	186.7	357.4	229.9	93.5	51.5	17.2	76.0
15-35	294.9	306.7	199.6	121.6	14.7	81.0	92.4
36-60	86.3	8.5	0.0	0.0	8.5	86.3	0.0
61-90	12.3	33.5	0.0	7.3	33.5	5.0	0.0
91-180	89.4	67.4	0.0	49.0	67.4	40.4	0.0
>180	66.8	25.0	10.0	50.0	5.0	6.8	10.0
Total	**736.4**	**798.5**	**439.5**	**321.4**	**180.6**	**236.6**	**178.4**

* 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	7.9 %	8.1 %	7.9 %	8.0 %
15-35	8.0 %	8.0 %	7.7 %	7.9 %
36-60	-	9.5 %	7.5 %	7.7 %
61-90	-	8.0 %	7.1 %	7.9 %
91-180	-	7.3 %	7.1 %	7.2 %
>180	6.8 %	7.1 %	7.2 %	7.1 %
Total	7.9 %	7.9 %	7.6 %	7.8 %

*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**	18	77	3498	3211	44	120	3103	3259	16	210	2076	3007
Intragrupo y off-shore***	0	0	1582	1372	0	0	1962	1184	0	0	1708	616
Otros	77	18	776	1273	120	44	706	1330	210	16	701	862
Total	**95**	**95**	**5856**	**5856**	**164**	**164**	**5772**	**5772**	**226**	**226**	**4485**	**4485**

* 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.