Fecha de Publicación: 14 de junio de 2016

Fecha de Información: 10 de junio 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$1534.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.3%.[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	332.8	367.7	291.5	224.0	6.5	39.1	69.7
15-35	269.3	427.7	285.5	78.0	56.8	105.9	85.4
36-60	66.1	3.1	0.0	0.0	3.1	66.1	0.0
61-90	36.2	3.0	0.0	0.0	3.0	36.2	0.0
91-180	72.7	43.5	30.0	70.0	13.5	2.7	0.0
>180	53.5	20.4	0.0	30.0	14.4	17.5	6.0
Total	**830.6**	**865.4**	**607.0**	**402.0**	**97.3**	**267.5**	**161.1**

* 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	8.6 %	8.0 %	5.6 %	7.0 %
15-35	8.3 %	7.5 %	7.7 %	7.7 %
36-60	-	9.0 %	7.4 %	7.5 %
61-90	-	8.1 %	7.1 %	7.1 %
91-180	-	7.5 %	7.3 %	7.4 %
>180	6.2 %	7.4 %	7.0 %	7.0 %
Total	8.3 %	7.7 %	6.7 %	7.3 %

*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**	16	77	3500	3212	54	131	3319	3571	17	212	2183	3045
Intragrupo y off-shore***	0	0	1582	1372	0	0	2217	1323	0	0	1745	701
Otros	77	16	776	1274	121	44	705	1347	211	17	702	885
Total	**92**	**93**	**5858**	**5858**	**175**	**175**	**6241**	**6241**	**229**	**229**	**4631**	**4631**

* 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.