Fecha de Publicación: 15 de junio de 2016

Fecha de Información: 13 de junio de lunes [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$1465.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.4%.[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	398.1	314.1	132.7	214.2	55.4	58.0	126.0
15-35	273.8	366.1	237.5	94.7	29.6	80.1	99.0
36-60	28.3	38.4	0.0	0.0	38.4	28.3	0.0
61-90	37.4	4.9	0.0	30.0	4.9	7.4	0.0
91-180	36.3	45.2	17.6	29.7	27.6	6.6	0.0
>180	116.8	91.3	0.0	40.0	30.9	16.4	60.4
Total	**890.8**	**859.9**	**387.7**	**408.6**	**186.8**	**196.8**	**285.4**

* 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	8.4 %	8.2 %	14.9 %	11.6 %
15-35	8.0 %	9.1 %	7.8 %	8.5 %
36-60	-	8.2 %	7.6 %	7.9 %
61-90	-	8.2 %	7.2 %	7.3 %
91-180	-	7.8 %	7.2 %	7.7 %
>180	7.2 %	7.3 %	6.9 %	7.1 %
Total	8.0 %	8.6 %	10.9 %	9.4 %

*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	13 al 17 de junio				20 al 24 de junio				27 de jun. al 1 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	121	3586	3740	19	212	2292	3175	12	146	2622	2455
Intragrupo y off-shore***	0	0	2258	1483	0	0	1837	755	0	0	1285	603
Otros	111	45	745	1365	212	19	722	921	146	12	550	1398
Total	**167**	**167**	**6588**	**6588**	**231**	**231**	**4851**	**4851**	**158**	**158**	**4457**	**4456**

* 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.