

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2016

Fecha de Información: 14 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\$1455.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.2%.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	272.7	262.0	141.0	218.0	84.0	17.7	37.0
15-35	366.9	472.8	334.0	110.3	19.8	137.6	119.0
36-60	55.1	42.5	25.0	1.5	17.5	53.6	0.0
61-90	16.9	14.5	0.0	15.5	14.5	1.4	0.0
91-180	55.8	37.7	0.0	32.0	37.7	23.8	0.0
>180	2.1	12.0	0.0	0.0	12.0	2.1	0.0
Total	769.5	841.5	500.0	377.3	185.5	236.2	156.0

* 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	
3-14	9.6 %	8.2 %	9.3 %	8.8 %
15-35	8.2 %	8.2 %	7.9 %	8.1 %
36-60	-	8.0 %	7.5 %	7.7 %
61-90	-	8.5 %	7.2 %	7.8 %
91-180	-	7.5 %	7.4 %	7.4 %
>180	-	7.4 %	6.9 %	7.3 %
Total	8.5 %	8.1 %	8.3 %	8.2 %

*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**	56	124	3784	3832	21	211	2354	3294	12	147	2644	2557
Intragrupo y off-shore***	0	0	2284	1664	0	0	1914	792	0	0	1365	603
Otros	114	46	790	1361	211	21	748	930	147	12	562	1410
Total	170	170	6858	6858	232	232	5017	5017	159	159	4570	4570

* 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.