

**Fecha de Publicación: 17 de junio de 2016**

**Fecha de Información: 15 de junio de miércoles <sup>1</sup>**

## **INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1734.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	443.4	358.1	153.4	276.3	155.1	117.5	49.6
15-35	290.0	471.3	382.6	109.5	38.2	129.9	50.6
36-60	1.5	12.9	0.0	0.0	12.9	1.5	0.0
61-90	52.6	40.9	0.0	0.0	40.9	52.6	0.0
91-180	0.9	27.4	20.0	0.0	7.4	0.9	0.0
>180	68.9	76.8	0.0	0.0	66.8	58.9	10.0
<b>Total</b>	<b>857.2</b>	<b>987.5</b>	<b>556.0</b>	<b>385.8</b>	<b>321.3</b>	<b>361.2</b>	<b>110.2</b>

\* 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 %	8.3 %	5.9 %	7.0 %
15-35	8.6 %	9.2 %	7.7 %	8.6 %
36-60	-	8.9 %	7.1 %	8.7 %
61-90	-	8.2 %	7.8 %	8.0 %
91-180	-	7.9 %	7.2 %	7.9 %
>180	6.9 %	7.0 %	6.9 %	7.0 %
<b>Total</b>	<b>8.3 %</b>	<b>8.6 %</b>	<b>6.7 %</b>	<b>7.8 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . 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
<b>Sector Financiero**</b>	56	137	4006	3885	22	209	2485	3480	12	147	2736	2686
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2333	1878	0	0	1995	850	0	0	1406	608
<b>Otros</b>	127	46	788	1363	209	22	817	966	147	12	644	1491
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>7126</b>	<b>7126</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>5296</b>	<b>5296</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>4785</b>	<b>4785</b>

\* 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.