

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2016

Fecha de Información: 17 de junio de viernes <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\$1406.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.<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	375.5	262.6	114.5	235.8	59.6	51.3	88.5
15-35	273.6	530.5	422.5	94.8	19.8	90.7	88.2
36-60	2.6	4.8	0.0	0.0	4.8	2.6	0.0
61-90	33.0	14.8	0.0	30.0	14.8	3.0	0.0
91-180	12.3	13.9	0.0	10.0	13.9	2.3	0.0
>180	41.4	24.0	15.0	30.0	3.0	5.4	6.0
<b>Total</b>	<b>738.4</b>	<b>850.5</b>	<b>552.0</b>	<b>400.5</b>	<b>115.8</b>	<b>155.2</b>	<b>182.7</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	7.9 %	7.8 %	7.2 %	7.5 %
15-35	8.5 %	8.4 %	8.3 %	8.4 %
36-60	-	8.5 %	8.0 %	8.3 %
61-90	-	8.3 %	7.6 %	7.8 %
91-180	-	8.2 %	7.6 %	7.9 %
>180	6.6 %	7.1 %	7.1 %	7.1 %
<b>Total</b>	<b>8.1 %</b>	<b>8.2 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>7.9 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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
<b>Sector Financiero**</b>	56	137	4099	4037	25	206	2995	3874	18	142	2849	2797
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2399	1925	0	0	2163	1159	0	0	1455	652
<b>Otros</b>	126	46	834	1369	206	25	920	1045	142	18	695	1550
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>7331</b>	<b>7331</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>6078</b>	<b>6078</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>4999</b>	<b>4999</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.