

**Fecha de Publicación: 8 de junio de 2016**

**Fecha de Información: 03 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\$1340.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	169.3	267.5	141.9	23.6	26.6	46.7	99.0
15-35	553.8	365.2	235.1	108.0	13.5	329.2	116.6
36-60	22.4	29.3	0.0	0.4	29.3	22.1	0.0
61-90	11.1	29.3	0.0	0.0	29.3	11.1	0.0
91-180	3.1	43.2	0.0	0.0	43.2	3.1	0.0
>180	21.2	40.4	30.0	10.0	10.4	11.2	0.0
<b>Total</b>	<b>780.9</b>	<b>774.9</b>	<b>407.0</b>	<b>141.9</b>	<b>152.3</b>	<b>423.4</b>	<b>215.6</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	8.0 %	8.1 %	6.7 %	7.7 %
15-35	7.9 %	8.3 %	7.6 %	7.8 %
36-60	-	8.0 %	7.2 %	7.7 %
61-90	-	8.0 %	6.9 %	7.7 %
91-180	-	7.9 %	6.5 %	7.8 %
>180	-	6.8 %	6.4 %	6.6 %
<b>Total</b>	<b>7.9 %</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.4 %</b>	<b>7.7 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	30 de may. al 3 de junio				6 al 10 de junio				13 al 17 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	86	3591	3305	14	77	3061	2856	37	132	2775	2704
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2007	1611	0	0	1381	1069	0	0	1617	1063
<b>Otros</b>	86	24	538	1215	77	14	742	1259	132	37	609	1234
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>6137</b>	<b>6132</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>5184</b>	<b>5184</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>5001</b>	<b>5001</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.