

**Fecha de Publicación: 10 de junio de 2016**

**Fecha de Información: 08 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\$2001.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.<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	389.0	267.4	155.5	307.2	57.1	27.1	54.8
15-35	513.2	602.5	374.0	112.0	76.5	249.2	152.0
36-60	114.5	16.2	1.0	0.0	15.2	114.5	0.0
61-90	47.5	66.1	0.0	10.0	66.0	37.5	0.0
91-180	92.6	51.0	0.0	91.6	51.0	1.0	0.0
>180	37.4	10.8	0.0	35.0	10.8	2.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1194.2</b>	<b>1014.0</b>	<b>530.5</b>	<b>555.8</b>	<b>276.6</b>	<b>431.7</b>	<b>206.8</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	
3-14	7.5 %	8.9 %	6.1 %	7.3 %
15-35	8.1 %	7.9 %	7.2 %	7.6 %
36-60	-	8.2 %	7.4 %	7.5 %
61-90	-	7.8 %	7.5 %	7.7 %
91-180	-	7.7 %	7.4 %	7.5 %
>180	-	8.1 %	7.3 %	7.5 %
<b>Total</b>	<b>7.9 %</b>	<b>8.1 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.5 %</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	6 al 10 de junio				13 al 17 de junio				20 al 24 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	17	77	3454	3131	40	120	3044	3070	15	209	2009	2929
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1546	1342	0	0	1816	1168	0	0	1661	569
Otros	76	17	757	1283	120	40	700	1322	209	15	686	858
Total	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>5756</b>	<b>5756</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5559</b>	<b>5559</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>4357</b>	<b>4357</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.