

**Fecha de Publicación: 30 de junio de 2016**

**Fecha de Información: 28 de junio de martes <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\$2727.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.<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	566.1	437.9	201.3	331.0	176.6	175.0	60.0
15-35	691.5	561.1	418.3	197.5	68.7	420.0	74.0
36-60	119.6	195.7	60.0	0.0	75.7	59.6	60.0
61-90	209.2	11.2	0.0	51.9	11.2	157.3	0.0
91-180	6.1	75.4	23.4	0.0	52.1	6.1	0.0
>180	14.4	33.4	0.0	10.0	33.4	4.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1606.9</b>	<b>1314.6</b>	<b>703.0</b>	<b>590.5</b>	<b>417.6</b>	<b>822.4</b>	<b>194.0</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	7.7 %	8.1 %	6.6 %	7.2 %
15-35	7.7 %	8.0 %	7.6 %	7.8 %
36-60	7.9 %	8.0 %	6.6 %	7.7 %
61-90	-	9.4 %	7.3 %	7.4 %
91-180	-	8.5 %	7.1 %	8.4 %
>180	-	7.9 %	7.4 %	7.7 %
<b>Total</b>	<b>7.7 %</b>	<b>8.1 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>7.6 %</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	27 de jun. al 1 de julio				4 al 8 de julio				11 al 15 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	289	3753	3607	17	101	2953	2863	14	159	2637	2453
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1805	1233	0	0	1525	1135	0	0	1250	723
<b>Otros</b>	289	22	1014	1732	101	17	567	1047	157	12	739	1450
<b>Total</b>	<b>310</b>	<b>310</b>	<b>6572</b>	<b>6572</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5045</b>	<b>5045</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>4626</b>	<b>4626</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.