

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2016

Fecha de Información: 01 de julio 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\$925.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	196.4	219.7	115.1	100.3	37.6	29.1	67.0
15-35	313.9	164.8	80.6	173.5	34.2	90.4	50.0
36-60	3.6	18.6	0.0	0.0	18.6	3.6	0.0
61-90	0.6	12.5	0.0	0.0	12.5	0.6	0.0
91-180	5.4	14.3	0.1	0.0	14.2	5.4	0.0
>180	67.9	80.4	10.0	10.0	14.4	1.9	56.0
<b>Total</b>	<b>587.9</b>	<b>510.2</b>	<b>205.8</b>	<b>283.8</b>	<b>131.4</b>	<b>131.1</b>	<b>173.0</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	7.5 %	8.5 %	7.0 %	7.9 %
15-35	7.5 %	7.0 %	7.3 %	7.3 %
36-60	-	8.7 %	6.7 %	8.4 %
61-90	-	8.1 %	6.9 %	8.1 %
91-180	-	7.8 %	7.3 %	7.6 %
>180	6.9 %	7.4 %	7.0 %	7.0 %
<b>Total</b>	<b>7.3 %</b>	<b>7.9 %</b>	<b>7.2 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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	291	4164	3664	19	109	3297	3187	16	162	3031	2710
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1831	1596	0	0	1620	1292	0	0	1285	924
<b>Otros</b>	291	22	1008	1743	109	19	666	1103	160	14	808	1490
<b>Total</b>	<b>313</b>	<b>313</b>	<b>7003</b>	<b>7003</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>5582</b>	<b>5582</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5124</b>	<b>5124</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.