

**Fecha de Publicación: 12 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 08 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\$1313.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	284.6	228.6	49.3	223.2	146.4	28.3	33.0
15-35	426.2	381.6	246.8	170.0	15.8	137.2	119.0
36-60	17.0	6.5	0.0	16.5	6.5	0.5	0.0
61-90	0.5	7.3	0.0	0.0	7.3	0.5	0.0
91-180	33.7	17.0	0.0	27.0	17.0	6.7	0.0
>180	36.1	36.1	0.0	0.0	26.1	26.1	10.0
<b>Total</b>	<b>798.0</b>	<b>677.2</b>	<b>296.1</b>	<b>436.7</b>	<b>219.1</b>	<b>199.3</b>	<b>162.0</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	8.2 %	8.9 %	6.3 %	7.6 %
15-35	7.5 %	7.7 %	8.0 %	7.8 %
36-60	-	8.4 %	7.1 %	7.5 %
61-90	-	8.3 %	7.0 %	8.2 %
91-180	-	7.8 %	7.2 %	7.7 %
>180	7.3 %	7.1 %	7.0 %	7.1 %
<b>Total</b>	<b>7.6 %</b>	<b>8.2 %</b>	<b>7.3 %</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	4 al 8 de julio				11 al 15 de julio				18 al 22 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	109	3918	3517	22	153	3566	3331	20	159	2397	2820
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1671	1772	0	0	1602	1283	0	0	1623	781
<b>Otros</b>	109	23	838	1138	151	20	1025	1579	159	20	494	913
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>6427</b>	<b>6427</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>6193</b>	<b>6193</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>4514</b>	<b>4514</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.