

**Fecha de Publicación: 13 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 11 de julio de lunes <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\$1405.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.<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	238.9	230.2	68.4	113.8	55.9	19.0	106.0
15-35	582.3	284.2	88.5	192.9	93.7	287.4	102.0
36-60	2.2	27.9	0.0	0.0	27.9	2.2	0.0
61-90	12.8	42.9	16.9	0.0	26.0	12.8	0.0
91-180	16.9	55.9	0.0	1.3	55.9	15.6	0.0
>180	37.5	81.4	0.0	0.0	81.4	37.5	0.0
<b>Total</b>	<b>890.5</b>	<b>722.5</b>	<b>173.7</b>	<b>308.0</b>	<b>340.7</b>	<b>374.5</b>	<b>208.0</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	8.5 %	8.4 %	7.3 %	8.1 %
15-35	7.4 %	7.2 %	7.1 %	7.2 %
36-60	-	8.0 %	5.5 %	7.8 %
61-90	-	7.8 %	7.2 %	7.6 %
91-180	-	0.4 %	3.3 %	1.1 %
>180	-	1.2 %	6.7 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>8.0 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>6.7 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	11 al 15 de julio				18 al 22 de julio				25 al 29 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	151	3770	3482	24	158	2433	2890	16	138	2833	2614
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1622	1396	0	0	1661	781	0	0	1374	1217
<b>Otros</b>	149	19	1074	1587	158	24	501	924	138	16	791	1167
<b>Total</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>6466</b>	<b>6466</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>4596</b>	<b>4596</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>4998</b>	<b>4998</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.