

**Fecha de Publicación: 18 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 14 de julio de jueves<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\$1577.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.<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	240.3	336.0	124.5	105.0	129.0	52.8	82.5
15-35	559.1	353.1	231.4	118.9	29.8	348.3	91.9
36-60	0.2	7.3	0.0	0.0	7.3	0.2	0.0
61-90	13.2	18.4	0.0	13.1	18.4	0.1	0.0
91-180	4.3	39.6	30.0	0.0	9.6	4.3	0.0
>180	87.4	98.5	20.4	10.7	72.1	70.8	6.0
<b>Total</b>	<b>904.5</b>	<b>852.9</b>	<b>406.3</b>	<b>247.6</b>	<b>266.2</b>	<b>476.5</b>	<b>180.4</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	7.8 %	7.4 %	8.2 %	7.7 %
15-35	5.9 %	7.3 %	7.5 %	7.2 %
36-60	-	7.8 %	6.9 %	7.8 %
61-90	-	8.2 %	7.3 %	8.0 %
91-180	-	7.7 %	7.2 %	7.6 %
>180	7.1 %	7.3 %	7.2 %	7.2 %
<b>Total</b>	<b>6.8 %</b>	<b>7.4 %</b>	<b>7.6 %</b>	<b>7.4 %</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	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>	20	153	4600	3973	25	161	2681	3205	20	138	3186	2985
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1663	1918	0	0	1879	940	0	0	1565	1345
Otros	151	18	1308	1681	161	25	549	964	138	20	849	1270
Total	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>7571</b>	<b>7571</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>5110</b>	<b>5110</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>5600</b>	<b>5600</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.