

**Fecha de Publicación: 19 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 15 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\$1587.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.<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	480.4	391.7	161.5	307.1	105.2	48.3	125.0
15-35	316.6	426.9	369.3	95.5	4.3	167.9	53.3
36-60	2.3	15.8	13.5	0.0	2.3	2.3	0.0
61-90	12.4	15.7	0.0	0.0	5.7	2.4	10.0
91-180	4.6	27.6	0.0	0.0	27.6	4.6	0.0
>180	51.6	30.5	30.0	20.0	0.5	31.6	0.0
<b>Total</b>	<b>867.9</b>	<b>908.2</b>	<b>574.3</b>	<b>422.6</b>	<b>145.7</b>	<b>257.1</b>	<b>188.3</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	5.7 %	7.6 %	5.2 %	6.1 %
15-35	7.4 %	7.4 %	7.3 %	7.3 %
36-60	-	8.1 %	7.0 %	7.5 %
61-90	7.5 %	7.9 %	7.1 %	7.6 %
91-180	-	7.8 %	7.2 %	7.7 %
>180	-	7.3 %	7.0 %	7.1 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.8 %</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>	20	153	4600	3972	23	137	3067	3435	22	138	3277	3170
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1663	1918	0	0	1913	1227	0	0	1693	1365
<b>Otros</b>	151	18	1307	1681	137	23	667	985	138	22	859	1294
<b>Total</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>7570</b>	<b>7570</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5647</b>	<b>5647</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5829</b>	<b>5829</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.