

**Fecha de Publicación: 21 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 18 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\$1312.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.<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	277.8	213.9	88.0	210.0	90.0	31.9	36.0
15-35	300.9	312.4	242.5	89.5	34.9	176.4	35.0
36-60	21.1	21.5	0.0	15.0	21.5	6.1	0.0
61-90	9.0	36.0	0.0	0.0	31.0	4.0	5.0
91-180	15.6	29.3	0.0	0.0	29.3	15.6	0.0
>180	123.4	52.8	25.0	30.0	2.8	68.4	25.0
<b>Total</b>	<b>747.8</b>	<b>665.8</b>	<b>355.5</b>	<b>344.5</b>	<b>209.4</b>	<b>302.4</b>	<b>101.0</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	8.7 %	7.8 %	4.9 %	6.4 %
15-35	7.9 %	7.5 %	7.4 %	7.5 %
36-60	-	7.9 %	7.4 %	7.7 %
61-90	7.6 %	7.9 %	6.6 %	7.7 %
91-180	-	7.8 %	7.1 %	7.6 %
>180	7.1 %	7.3 %	6.9 %	7.0 %
<b>Total</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.7 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>7.1 %</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	18 al 22 de julio				25 al 29 de julio				1 al 5 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	130	3307	3584	24	134	3310	3238	9	80	2297	2075
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1942	1429	0	0	1752	1374	0	0	1074	697
<b>Otros</b>	130	25	751	987	134	24	869	1318	80	9	346	945
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6000</b>	<b>6000</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>5930</b>	<b>5930</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>3717</b>	<b>3717</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.