

**Fecha de Publicación: 22 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 19 de julio de martes<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\$1660.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.5%.<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	519.9	159.1	42.5	428.0	81.6	56.9	35.0
15-35	351.8	653.9	555.5	124.5	5.4	134.3	93.0
36-60	9.0	2.7	0.0	0.0	2.7	9.0	0.0
61-90	0.4	5.9	0.0	0.0	5.9	0.4	0.0
91-180	0.7	16.1	0.0	0.0	16.0	0.5	0.2
>180	18.0	60.6	50.0	8.0	0.6	0.0	10.0
<b>Total</b>	<b>899.8</b>	<b>898.3</b>	<b>648.0</b>	<b>560.5</b>	<b>112.1</b>	<b>201.2</b>	<b>138.2</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 %	5.9 %	11.8 %	10.2 %
15-35	5.5 %	7.9 %	6.7 %	7.3 %
36-60	-	8.0 %	7.0 %	7.2 %
61-90	-	8.6 %	7.3 %	8.5 %
91-180	7.2 %	9.2 %	7.1 %	9.1 %
>180	7.0 %	7.4 %	-	7.3 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>9.9 %</b>	<b>8.5 %</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	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>	23	132	3734	3663	23	134	3365	3284	11	80	2388	2144
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1944	1812	0	0	1763	1418	0	0	1116	728
Otros	132	23	793	996	134	23	903	1329	80	11	358	990
Total	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6471</b>	<b>6471</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>6030</b>	<b>6030</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>3862</b>	<b>3862</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.