

**Fecha de Publicación: 25 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 21 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\$1102.9 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	157.4	247.0	131.1	73.4	54.9	23.0	61.0
15-35	391.2	362.0	220.3	73.0	48.8	225.2	93.0
36-60	10.1	3.1	0.0	0.0	3.1	10.1	0.0
61-90	7.6	12.4	0.0	0.0	12.4	7.6	0.0
91-180	7.7	25.6	0.0	0.0	25.6	7.7	0.0
>180	16.3	16.6	0.0	5.0	16.6	11.3	0.0
<b>Total</b>	<b>590.2</b>	<b>666.6</b>	<b>351.3</b>	<b>151.4</b>	<b>161.3</b>	<b>284.8</b>	<b>154.0</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	
3-14	6.9 %	7.7 %	6.9 %	7.4 %
15-35	6.3 %	6.5 %	6.2 %	6.3 %
36-60	-	7.9 %	7.3 %	7.4 %
61-90	-	8.0 %	7.3 %	7.7 %
91-180	-	7.6 %	7.2 %	7.5 %
>180	-	6.7 %	6.7 %	6.7 %
<b>Total</b>	<b>6.5 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>6.4 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$ . 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>	24	130	3792	3741	24	138	3437	3442	11	80	2405	2146
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1974	1851	0	0	1869	1443	0	0	1116	737
Otros	130	24	811	985	138	24	924	1345	80	11	361	998
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>6577</b>	<b>6577</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6230</b>	<b>6230</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>3882</b>	<b>3882</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.