

**Fecha de Publicación: 28 de julio de 2016**

**Fecha de Información: 26 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\$1847.7 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	287.8	299.1	153.0	168.5	60.1	33.3	86.0
15-35	510.2	688.1	421.4	165.3	50.2	128.4	216.5
36-60	39.0	47.0	0.0	0.1	47.0	38.9	0.0
61-90	29.9	3.4	0.0	20.0	3.4	9.9	0.0
91-180	40.9	93.0	59.0	0.0	21.0	27.9	13.0
>180	64.6	60.3	20.0	25.0	40.3	39.6	0.0
<b>Total</b>	<b>972.4</b>	<b>1190.9</b>	<b>653.4</b>	<b>378.9</b>	<b>222.0</b>	<b>278.0</b>	<b>315.5</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 %	7.1 %	5.1 %	6.4 %
15-35	7.8 %	8.1 %	7.6 %	7.9 %
36-60	-	7.7 %	7.3 %	7.5 %
61-90	-	8.6 %	7.3 %	7.5 %
91-180	7.3 %	7.5 %	6.7 %	7.2 %
>180	-	7.2 %	7.0 %	7.1 %
<b>Total</b>	<b>7.8 %</b>	<b>7.7 %</b>	<b>6.6 %</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	25 al 29 de julio				1 al 5 de agosto				8 al 12 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	128	3863	3998	14	81	2610	2423	10	87	3024	2866
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2163	1732	0	0	1289	803	0	0	1373	835
Otros	128	22	1075	1372	81	14	386	1058	87	10	698	1393
Total	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>7102</b>	<b>7102</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>4285</b>	<b>4285</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>5095</b>	<b>5095</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.