

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2015

Fecha de Información: 05 de agosto de miércoles <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\$1759.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	329.4	192.9	63.5	174.5	44.4	69.9	85.0
15-35	527.8	543.9	375.1	282.5	83.8	160.3	85.0
36-60	12.9	46.6	35.0	10.0	11.6	2.9	0.0
61-90	40.6	52.4	0.0	0.0	12.4	0.6	40.0
91-180	104.6	95.0	40.3	35.0	19.7	34.6	35.0
>180	36.6	22.2	3.0	10.0	19.2	26.6	0.0
<b>Total</b>	<b>1052.0</b>	<b>953.0</b>	<b>516.8</b>	<b>512.0</b>	<b>191.2</b>	<b>295.0</b>	<b>245.0</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	0.6 %	1.4 %	0.6 %	0.8 %
15-35	1.0 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.9 %	1.2 %	1.7 %
61-90	2.4 %	3.1 %	2.0 %	2.6 %
91-180	2.9 %	3.2 %	2.9 %	3.0 %
>180	-	3.5 %	2.8 %	3.1 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.3 %</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	3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	49	87	3956	3786	24	112	4366	3943	13	102	2893	2690
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2257	1946	0	0	2307	1244	0	0	1689	833
<b>Otros</b>	87	49	606	1086	112	24	585	2072	102	13	485	1544
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6819</b>	<b>6819</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>7258</b>	<b>7258</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>5067</b>	<b>5067</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.