

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2015

Fecha de Información: 06 de agosto 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\$1111.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	364.0	192.2	29.0	188.8	37.7	49.7	125.5
15-35	149.5	295.6	110.3	96.8	160.9	28.2	24.5
36-60	4.4	12.8	0.2	0.0	12.6	4.4	0.0
61-90	23.0	47.1	0.0	10.0	37.1	3.0	10.0
91-180	26.8	91.5	0.0	0.0	91.5	26.8	0.0
>180	61.4	3.5	0.0	0.0	3.5	61.4	0.0
<b>Total</b>	<b>629.0</b>	<b>642.8</b>	<b>139.5</b>	<b>295.6</b>	<b>343.3</b>	<b>173.5</b>	<b>160.0</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	1.1 %	1.9 %	0.8 %	1.1 %
15-35	1.3 %	1.6 %	1.1 %	1.5 %
36-60	-	3.4 %	1.6 %	2.9 %
61-90	2.8 %	3.1 %	2.4 %	2.9 %
91-180	-	3.4 %	2.8 %	3.3 %
>180	-	3.6 %	2.9 %	3.0 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.8 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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	3787	25	115	4669	4091	19	103	2954	2730
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2257	1946	0	0	2322	1409	0	0	1703	856
<b>Otros</b>	87	49	607	1087	115	25	604	2096	103	19	500	1571
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6820</b>	<b>6820</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>7595</b>	<b>7595</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>5157</b>	<b>5157</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.