

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2015

Fecha de Información: 14 de agosto de viernes <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\$936.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 2

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.8 %	1.3 %	0.8 %	0.9 %
15-35	1.0 %	1.5 %	1.0 %	1.2 %
36-60	-	2.2 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	2.8 %	1.4 %	2.4 %
91-180	-	2.9 %	2.2 %	2.7 %
>180	3.2 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	212.5	194.7	44.0	95.0	63.7	30.5	87.0
15-35	208.9	223.3	132.0	67.0	14.3	64.9	77.0
36-60	25.3	7.3	0.0	0.0	7.3	25.3	0.0
61-90	2.0	6.1	0.0	0.0	6.1	2.0	0.0
91-180	40.7	68.2	20.0	15.0	48.2	25.7	0.0
>180	40.3	90.5	60.0	3.8	11.0	17.0	19.5
<b>Total</b>	<b>529.6</b>	<b>590.2</b>	<b>256.0</b>	<b>180.8</b>	<b>150.7</b>	<b>165.3</b>	<b>183.5</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.

<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	10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	103	5446	4297	26	139	3589	3191	26	1031	3724	2893
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2384	2048	0	0	1816	1035	0	0	1496	1374
<b>Otros</b>	103	40	625	2110	139	26	527	1706	1031	26	572	1525
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>8455</b>	<b>8455</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5932</b>	<b>5932</b>	<b>1057</b>	<b>1057</b>	<b>5792</b>	<b>5792</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.