

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2015

Fecha de Información: 21 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\$1277.8 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	465.0	160.7	11.0	216.8	50.7	149.2	99.0
15-35	191.9	377.1	266.7	94.5	45.4	32.4	65.0
36-60	27.6	17.4	0.0	13.3	17.4	14.3	0.0
61-90	4.8	8.3	0.0	2.5	8.3	2.3	0.0
91-180	54.6	56.8	20.0	7.1	20.8	31.6	16.0
>180	60.5	33.1	30.0	4.6	3.1	55.9	0.0
<b>Total</b>	<b>804.4</b>	<b>653.4</b>	<b>327.7</b>	<b>338.7</b>	<b>145.8</b>	<b>285.7</b>	<b>180.0</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	0.1 %	6.4 %	0.4 %	1.0 %
15-35	1.4 %	1.5 %	0.1 %	1.2 %
36-60	-	1.8 %	1.3 %	1.5 %
61-90	-	2.5 %	1.3 %	2.1 %
91-180	2.0 %	3.0 %	2.1 %	2.3 %
>180	-	3.1 %	2.6 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>0.7 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>0.7 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	142	4250	3369	28	1112	4454	3367	5	108	2788	3218
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1896	1594	0	0	1655	1748	0	0	2047	1037
<b>Otros</b>	142	26	567	1751	1112	28	652	1645	108	5	439	1020
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6714</b>	<b>6714</b>	<b>1140</b>	<b>1140</b>	<b>6761</b>	<b>6761</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5274</b>	<b>5274</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.