

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2015

Fecha de Información: 24 de agosto de lunes <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\$1384.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292.3	190.2	60.4	166.5	93.8	89.7	36.0
15-35	424.5	302.7	146.0	237.8	53.7	83.7	103.0
36-60	27.3	117.9	60.0	10.0	57.9	17.3	0.0
61-90	5.2	7.4	1.1	0.0	6.3	5.2	0.0
91-180	5.7	82.1	22.0	0.0	60.1	5.7	0.0
>180	27.4	41.1	20.0	7.1	21.1	20.3	0.0
<b>Total</b>	<b>782.3</b>	<b>741.5</b>	<b>309.4</b>	<b>421.4</b>	<b>293.0</b>	<b>221.9</b>	<b>139.0</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	0.0 %	1.6 %	-0.3 %	0.4 %
15-35	0.3 %	0.6 %	0.3 %	0.4 %
36-60	-	1.5 %	1.0 %	1.4 %
61-90	-	3.4 %	1.3 %	2.5 %
91-180	-	2.7 %	1.5 %	2.7 %
>180	-	3.1 %	2.3 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>0.2 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>0.2 %</b>	<b>0.8 %</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	24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	27	1112	4564	3519	6	114	2967	3275	18	98	1827	2026
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1693	1800	0	0	2070	1151	0	0	1319	553
<b>Otros</b>	1112	27	741	1678	114	6	463	1074	98	18	410	977
<b>Total</b>	<b>1140</b>	<b>1140</b>	<b>6998</b>	<b>6998</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>5501</b>	<b>5501</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>3557</b>	<b>3557</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.