

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2015

Fecha de Información: 26 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\$1505.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.<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	443.1	151.6	26.0	301.8	42.1	57.9	83.4
15-35	344.3	464.3	335.9	68.0	42.0	189.9	86.4
36-60	8.3	36.5	0.0	0.0	36.5	8.3	0.0
61-90	15.2	18.5	0.1	1.0	8.4	4.2	10.0
91-180	78.7	29.0	9.5	0.0	9.6	68.7	10.0
>180	79.8	76.2	6.3	24.0	20.0	5.8	50.0
<b>Total</b>	<b>969.5</b>	<b>776.1</b>	<b>377.6</b>	<b>394.8</b>	<b>158.6</b>	<b>334.9</b>	<b>239.9</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	0.5 %	2.8 %	-0.4 %	0.2 %
15-35	0.2 %	0.6 %	-0.1 %	0.3 %
36-60	-	1.4 %	0.2 %	1.2 %
61-90	1.5 %	5.9 %	0.5 %	2.8 %
91-180	2.1 %	3.4 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.9 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>0.1 %</b>	<b>0.6 %</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>	24	1102	5058	3739	8	125	3271	3501	18	99	2179	2193
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1738	2118	0	0	2163	1263	0	0	1402	596
<b>Otros</b>	1102	24	772	1712	125	8	472	1142	99	18	454	1246
<b>Total</b>	<b>1126</b>	<b>1126</b>	<b>7568</b>	<b>7568</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5906</b>	<b>5906</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4035</b>	<b>4035</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.