

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2016

Fecha de Información: 23 de agosto de martes <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\$1859.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.<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	535.5	327.7	63.5	277.0	108.7	103.0	155.5
15-35	465.5	486.1	269.0	142.5	70.6	176.5	146.5
36-60	31.3	85.4	80.0	0.0	5.4	31.3	0.0
61-90	0.8	6.5	0.0	0.0	6.5	0.8	0.0
91-180	3.9	23.3	10.0	0.0	11.5	2.1	1.8
>180	132.0	120.6	0.0	17.2	64.9	59.1	55.7
<b>Total</b>	<b>1169.0</b>	<b>1049.6</b>	<b>422.5</b>	<b>436.7</b>	<b>267.6</b>	<b>372.8</b>	<b>359.5</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.

Cuadro No. 2

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.1 %	7.9 %	5.3 %	5.9 %
15-35	7.5 %	7.1 %	7.5 %	7.3 %
36-60	-	8.0 %	7.5 %	7.8 %
61-90	-	8.0 %	6.8 %	7.9 %
91-180	7.2 %	7.5 %	6.8 %	7.4 %
>180	6.9 %	7.0 %	7.0 %	7.0 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>7.4 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.8 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	22 al 26 de agosto				29 de ago. al 2 de septiembre				5 al 9 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	254	131	3250	3324	76	164	3517	4400	7	59	2277	2049
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	115	1324	1142	0	0	2427	907	0	0	1184	966
<b>Otros</b>	131	139	1077	1180	164	76	835	1467	59	7	407	853
<b>Total</b>	<b>385</b>	<b>385</b>	<b>5651</b>	<b>5646</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>6779</b>	<b>6774</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>3868</b>	<b>3868</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.