

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1250.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.<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	230.5	215.3	48.2	107.4	123.1	79.2	44.0
15-35	355.4	323.0	168.0	94.9	92.0	197.5	63.0
36-60	0.3	17.4	0.0	0.0	17.4	0.3	0.0
61-90	3.1	8.3	0.0	0.0	8.3	3.1	0.0
91-180	20.1	38.4	0.0	0.0	38.4	20.1	0.0
>180	70.8	74.8	0.0	0.0	74.8	70.8	0.0
<b>Total</b>	<b>680.1</b>	<b>677.1</b>	<b>216.2</b>	<b>202.3</b>	<b>353.9</b>	<b>370.9</b>	<b>107.0</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	6.9 %	7.8 %	7.2 %	7.4 %
15-35	7.3 %	7.5 %	6.5 %	7.0 %
36-60	-	8.0 %	7.2 %	8.0 %
61-90	-	7.6 %	7.4 %	7.6 %
91-180	-	7.6 %	6.7 %	7.3 %
>180	-	6.9 %	6.8 %	6.8 %
<b>Total</b>	<b>7.1 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>6.8 %</b>	<b>7.2 %</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	3620	3513	92	150	4020	4760	9	61	2428	2205
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	115	1357	1419	0	14	2470	1211	0	0	1259	998
<b>Otros</b>	131	139	1152	1192	150	78	1047	1562	61	9	429	913
<b>Total</b>	<b>386</b>	<b>386</b>	<b>6129</b>	<b>6124</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>7537</b>	<b>7532</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>4116</b>	<b>4116</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.