

Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 30 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\$2195.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.<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	522.9	261.0	68.5	394.9	122.5	58.0	70.0
15-35	427.6	778.0	468.2	122.1	229.8	225.5	80.0
36-60	36.5	69.0	55.0	0.0	14.0	36.5	0.0
61-90	1.1	11.0	0.0	0.0	11.0	1.1	0.0
91-180	64.8	41.2	20.1	60.0	19.8	3.5	1.3
>180	75.1	74.5	0.0	0.0	58.4	59.0	16.1
<b>Total</b>	<b>1128.0</b>	<b>1234.6</b>	<b>611.7</b>	<b>577.0</b>	<b>455.5</b>	<b>383.6</b>	<b>167.4</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.6 %	7.5 %	6.5 %	6.7 %
15-35	7.6 %	8.6 %	7.4 %	8.1 %
36-60	-	7.5 %	6.9 %	7.3 %
61-90	-	8.0 %	6.4 %	7.8 %
91-180	6.9 %	7.4 %	6.7 %	7.0 %
>180	6.6 %	6.9 %	6.8 %	6.8 %
<b>Total</b>	<b>6.6 %</b>	<b>8.2 %</b>	<b>6.9 %</b>	<b>7.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

Sector	29 de ago. al 2 de septiembre				5 al 9 de septiembre				12 al 16 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	97	159	4688	5043	12	61	2633	2389	16	137	3352	2747
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	14	2580	1725	0	0	1329	1128	0	0	1119	1027
<b>Otros</b>	159	83	1128	1623	61	12	499	944	137	16	993	1690
<b>Total</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>8396</b>	<b>8391</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>4461</b>	<b>4461</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>5465</b>	<b>5465</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.

<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 intragruppo.