

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 01 de septiembre de jueves <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\$1835.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.<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	352.3	276.8	149.0	194.1	17.1	47.6	110.7
15-35	456.8	755.8	531.5	88.5	34.3	178.3	190.0
36-60	36.2	6.2	0.0	0.0	5.0	34.9	1.3
61-90	3.2	14.6	0.0	0.0	14.6	3.2	0.0
91-180	23.1	14.8	0.0	0.0	14.8	23.1	0.0
>180	107.0	109.7	8.0	0.0	82.3	87.6	19.4
<b>Total</b>	<b>978.6</b>	<b>1177.9</b>	<b>688.5</b>	<b>282.6</b>	<b>168.1</b>	<b>374.7</b>	<b>321.3</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	7.7 %	7.6 %	15.3 %	10.9 %
15-35	5.9 %	7.1 %	7.1 %	6.9 %
36-60	7.3 %	7.4 %	6.9 %	7.0 %
61-90	-	6.9 %	6.7 %	6.9 %
91-180	-	7.1 %	6.6 %	6.8 %
>180	6.6 %	6.5 %	6.3 %	6.4 %
<b>Total</b>	-	7.2 %	9.7 %	8.0 %

\*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	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	160	5188	5158	53	62	3031	2707	17	140	3455	2905
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	14	2620	2188	0	0	1484	1392	0	0	1197	1033
<b>Otros</b>	159	83	1169	1626	62	53	576	992	140	17	1044	1757
<b>Total</b>	<b>257</b>	<b>257</b>	<b>8976</b>	<b>8971</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>5091</b>	<b>5091</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>5696</b>	<b>5696</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.