

Fecha de Publicación: 9 de agosto de 2016

Fecha de Información: 05 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\$992.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.<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	190.7	255.1	76.0	43.0	73.1	41.7	106.0
15-35	405.0	251.9	125.9	197.8	40.2	121.5	85.8
36-60	13.3	12.9	4.5	0.0	8.4	13.3	0.0
61-90	2.0	15.4	0.0	0.0	15.4	2.0	0.0
91-180	0.2	19.1	0.0	0.0	19.1	0.2	0.0
>180	3.1	15.4	0.0	0.0	15.4	3.1	0.0
<b>Total</b>	<b>614.3</b>	<b>569.8</b>	<b>206.4</b>	<b>240.8</b>	<b>171.7</b>	<b>181.8</b>	<b>191.8</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	8.1 %	8.4 %	7.8 %	8.2 %
15-35	7.9 %	5.2 %	7.7 %	7.0 %
36-60	-	8.2 %	7.7 %	7.9 %
61-90	-	8.2 %	7.6 %	8.2 %
91-180	-	7.7 %	6.7 %	7.7 %
>180	-	7.4 %	6.2 %	7.2 %
<b>Total</b>	<b>8.1 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.7 %</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.

<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	1 al 5 de agosto				8 al 12 de agosto				15 al 19 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	77	3520	3462	16	109	3369	3536	21	76	2376	2749
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1613	1385	0	0	1712	845	0	0	1578	739
<b>Otros</b>	77	24	921	1206	109	16	821	1481	76	21	530	986
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>6053</b>	<b>6053</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>5901</b>	<b>5861</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>4484</b>	<b>4473</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.