

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2016

Fecha de Información: 09 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\$1221.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.<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	245.2	179.0	20.0	124.5	86.0	47.7	73.0
15-35	414.4	391.0	212.0	123.0	64.0	176.4	115.0
36-60	32.4	29.9	0.0	9.6	9.3	2.2	20.6
61-90	0.2	4.7	0.0	0.0	4.7	0.2	0.0
91-180	13.7	31.6	0.0	10.0	31.6	3.7	0.0
>180	48.9	49.4	0.2	0.0	39.2	38.9	10.0
<b>Total</b>	<b>754.7</b>	<b>685.6</b>	<b>232.2</b>	<b>267.1</b>	<b>234.8</b>	<b>269.0</b>	<b>218.6</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	8.5 %	8.4 %	6.6 %	7.6 %
15-35	7.9 %	8.0 %	7.4 %	7.7 %
36-60	8.0 %	8.6 %	7.5 %	8.2 %
61-90	-	8.5 %	7.1 %	8.5 %
91-180	-	7.8 %	7.7 %	7.7 %
>180	7.2 %	7.2 %	6.9 %	7.0 %
<b>Total</b>	<b>8.1 %</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>7.7 %</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**

Sectores	8 al 12 de agosto				15 al 19 de agosto				22 al 26 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	113	4030	4084	22	86	2516	2978	257	100	2248	2358
Intragruppo y off-shore***	0	0	1913	1205	3	0	1674	772	0	115	1019	589
Otros	113	18	935	1549	83	22	607	1036	100	142	642	957
<b>Total</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>6878</b>	<b>6838</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4797</b>	<b>4786</b>	<b>357</b>	<b>357</b>	<b>3909</b>	<b>3904</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.