

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2016

Fecha de Información: 12 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\$1384.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.3%.<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	309.8	273.5	65.2	112.0	127.3	116.8	81.0
15-35	486.6	376.0	189.2	187.6	56.7	168.9	130.1
36-60	23.0	9.4	0.0	0.0	9.2	22.8	0.1
61-90	13.3	23.3	0.0	0.0	23.1	13.1	0.1
91-180	3.1	40.6	0.0	0.0	40.5	3.0	0.1
>180	18.3	18.7	0.0	0.0	18.7	18.3	0.0
<b>Total</b>	<b>854.0</b>	<b>741.5</b>	<b>254.4</b>	<b>299.6</b>	<b>275.7</b>	<b>342.9</b>	<b>211.5</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 %	8.4 %	6.9 %	7.6 %
15-35	7.5 %	8.4 %	5.9 %	7.1 %
36-60	8.1 %	8.9 %	7.7 %	8.1 %
61-90	8.0 %	8.6 %	7.0 %	8.0 %
91-180	7.8 %	8.0 %	7.2 %	8.0 %
>180	-	7.3 %	6.9 %	7.1 %
<b>Total</b>	<b>7.5 %</b>	<b>8.3 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>7.3 %</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	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
<b>Sector Financiero**</b>	17	105	4685	4257	22	101	2890	3358	257	107	2383	2560
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1940	1702	3	0	1777	905	0	115	1087	605
<b>Otros</b>	105	17	1020	1645	99	22	770	1163	107	142	714	1013
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>7645</b>	<b>7605</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5437</b>	<b>5426</b>	<b>364</b>	<b>364</b>	<b>4184</b>	<b>4179</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.