

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 07 de septiembre de lunes <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\$72.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<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	34.1	20.9	2.0	2.0	3.9	17.1	15.0
15-35	3.2	12.3	9.0	0.0	3.3	3.2	0.0
36-60	0.6	3.2	0.0	0.0	3.2	0.6	0.0
61-90	1.2	1.5	0.0	0.0	1.5	1.2	0.0
91-180	2.0	2.1	0.0	0.0	2.1	2.0	0.0
>180	4.8	2.0	0.0	0.0	2.0	4.8	0.0
<b>Total</b>	<b>45.8</b>	<b>42.0</b>	<b>11.0</b>	<b>2.0</b>	<b>16.0</b>	<b>28.8</b>	<b>15.0</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	3.0 %	1.8 %	1.1 %	1.9 %
15-35	-	2.3 %	1.8 %	2.2 %
36-60	-	3.2 %	2.5 %	3.1 %
61-90	-	3.9 %	2.3 %	3.2 %
91-180	-	3.8 %	3.1 %	3.5 %
>180	-	3.9 %	1.1 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>3.0 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>2.2 %</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	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	32	104	3216	2815	20	134	3102	3241	13	179	2392	2632
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1700	1090	0	0	1926	972	0	0	1563	1014
<b>Otros</b>	104	32	596	1607	134	20	564	1378	179	13	604	913
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5513</b>	<b>5513</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>5592</b>	<b>5592</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>4559</b>	<b>4559</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.