

**Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2015**

**Fecha de Información: 22 de septiembre 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\$1065.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.<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	319.0	225.1	86.0	109.0	34.1	105.0	105.0
15-35	222.7	247.1	131.8	88.4	37.8	56.8	77.5
36-60	5.0	61.3	0.0	0.0	61.3	5.0	0.0
61-90	4.4	3.3	0.0	0.0	3.3	4.4	0.0
91-180	6.5	102.6	25.0	0.0	77.6	6.5	0.0
>180	40.3	10.9	5.1	0.0	5.8	40.3	0.0
<b>Total</b>	<b>598.0</b>	<b>650.2</b>	<b>247.8</b>	<b>197.4</b>	<b>219.9</b>	<b>218.1</b>	<b>182.5</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	2.8 %	2.2 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	3.5 %	2.2 %	3.4 %
61-90	-	3.7 %	2.9 %	3.2 %
91-180	-	3.6 %	3.0 %	3.6 %
>180	-	3.7 %	3.2 %	3.3 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.7 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	195	3793	3665	15	123	2804	3076	15	109	2601	3020
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1889	1596	0	0	1646	966	0	0	1960	689
<b>Otros</b>	194	18	768	1189	123	15	935	1344	109	15	548	1400
<b>Total</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>6450</b>	<b>6450</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>5385</b>	<b>5385</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5109</b>	<b>5109</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.