

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2015

Fecha de Información: 25 de septiembre 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\$1162.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<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	291.0	108.7	36.0	169.3	27.7	76.8	45.0
15-35	318.7	457.0	320.3	147.8	66.8	100.9	70.0
36-60	2.8	3.1	0.0	0.0	3.1	2.8	0.0
61-90	14.4	37.1	30.0	0.0	7.1	14.4	0.0
91-180	10.2	25.7	0.0	0.0	15.7	0.2	10.0
>180	2.4	16.6	0.0	0.0	16.6	2.4	0.0
<b>Total</b>	<b>639.6</b>	<b>648.2</b>	<b>386.3</b>	<b>317.1</b>	<b>136.9</b>	<b>197.5</b>	<b>125.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	2.1 %	2.6 %	2.3 %
15-35	2.9 %	2.0 %	2.9 %	2.4 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.6 %
61-90	-	3.6 %	3.1 %	3.5 %
91-180	3.7 %	3.9 %	4.9 %	3.8 %
>180	-	4.0 %	3.8 %	4.0 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>2.5 %</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	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>	17	185	3987	3728	20	119	3202	3328	17	110	2979	3309
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1898	1762	0	0	1716	1173	0	0	2078	831
<b>Otros</b>	185	17	804	1199	119	20	1002	1420	110	17	575	1491
<b>Total</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>6689</b>	<b>6689</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5921</b>	<b>5921</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>5631</b>	<b>5631</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.