

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2015

Fecha de Información: 29 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\$1557.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	405.5	250.3	99.0	237.5	61.3	78.0	90.0
15-35	444.4	415.0	271.5	91.0	59.0	268.9	84.5
36-60	12.0	14.3	0.0	10.0	14.3	2.0	0.0
61-90	3.9	7.8	0.0	0.0	7.8	3.9	0.0
91-180	39.2	24.6	0.0	15.0	4.6	4.2	20.0
>180	103.2	75.6	0.0	35.0	31.3	23.9	44.3
<b>Total</b>	<b>1008.3</b>	<b>787.6</b>	<b>370.5</b>	<b>388.5</b>	<b>178.3</b>	<b>381.0</b>	<b>238.8</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	2.6 %	3.9 %	1.8 %	2.5 %
15-35	2.9 %	3.9 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.9 %	3.4 %	3.6 %
61-90	-	4.1 %	2.8 %	3.7 %
91-180	4.5 %	4.4 %	4.0 %	4.3 %
>180	4.3 %	4.8 %	4.3 %	4.4 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>4.0 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.3 %</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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	127	3721	3538	26	112	3234	3526	26	142	2271	2454
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1809	1561	0	0	2135	906	0	1	1451	419
<b>Otros</b>	127	21	1044	1476	112	26	610	1547	142	25	628	1478
<b>Total</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6574</b>	<b>6574</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>5979</b>	<b>5979</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4351</b>	<b>4351</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.