

**Fecha de Publicación: 2 de septiembre de 2015**

**Fecha de Información: 31 de agosto 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\$1416.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	298.9	191.5	53.4	177.0	77.7	61.5	60.4
15-35	317.3	373.2	157.9	149.7	170.3	122.6	45.0
36-60	16.1	21.0	0.0	0.0	21.0	16.1	0.0
61-90	3.4	14.5	0.0	0.0	14.5	3.4	0.0
91-180	75.2	94.7	0.0	0.0	84.7	65.2	10.0
>180	82.3	93.7	25.0	6.2	18.7	26.1	50.0
<b>Total</b>	<b>793.2</b>	<b>788.6</b>	<b>236.3</b>	<b>332.9</b>	<b>386.9</b>	<b>294.9</b>	<b>165.4</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	
3-14	0.5 %	0.7 %	0.3 %	0.4 %
15-35	0.8 %	1.4 %	1.4 %	1.3 %
36-60	-	2.3 %	1.1 %	1.8 %
61-90	-	2.7 %	0.8 %	2.3 %
91-180	2.3 %	3.1 %	2.0 %	2.6 %
>180	3.2 %	3.4 %	2.8 %	3.2 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.4 %</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	163	3854	3930	23	100	2663	2368	15	133	2448	2787
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2322	1541	0	0	1432	787	0	0	1721	662
<b>Otros</b>	163	12	604	1308	100	23	541	1482	133	15	490	1208
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>6779</b>	<b>6779</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>4636</b>	<b>4636</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4658</b>	<b>4658</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.