

**Fecha de Publicación: 8 de septiembre de 2015**

**Fecha de Información: 04 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\$899.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	253.9	143.1	62.0	146.0	51.1	77.9	30.0
15-35	223.6	216.4	185.4	94.2	16.0	114.4	15.0
36-60	11.1	8.2	0.0	0.0	8.2	11.1	0.0
61-90	1.0	5.0	0.0	0.0	5.0	1.0	0.0
91-180	3.0	47.3	30.0	0.0	17.3	3.0	0.0
>180	25.1	26.8	0.0	0.0	6.8	5.1	20.0
<b>Total</b>	<b>517.8</b>	<b>446.7</b>	<b>277.4</b>	<b>240.2</b>	<b>104.3</b>	<b>212.6</b>	<b>65.0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	2.5 %	1.5 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.2 %	1.6 %	2.0 %
36-60	-	3.0 %	1.9 %	2.4 %
61-90	-	3.2 %	2.3 %	3.1 %
91-180	-	3.3 %	2.9 %	3.3 %
>180	3.5 %	3.7 %	3.5 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>2.0 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

**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>	14	164	4368	4213	28	100	3213	2812	20	135	3077	3226
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2414	1848	0	0	1698	1088	0	0	1926	972
<b>Otros</b>	164	14	677	1398	100	28	595	1605	135	20	564	1368
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>7459</b>	<b>7459</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5506</b>	<b>5506</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>5566</b>	<b>5566</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.