

**Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2015**

**Fecha de Información: 09 de septiembre de miércoles<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\$1986.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.<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	517.8	285.3	161.5	338.2	18.8	74.6	105.0
15-35	519.5	568.8	505.8	73.0	42.6	426.0	20.5
36-60	15.9	5.0	0.0	0.2	5.0	15.8	0.0
61-90	2.9	36.2	0.0	0.0	36.2	2.9	0.0
91-180	84.6	49.7	30.0	75.7	17.4	6.6	2.3
>180	20.9	7.8	0.0	20.7	7.8	0.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1161.8</b>	<b>952.8</b>	<b>697.3</b>	<b>507.8</b>	<b>127.7</b>	<b>526.2</b>	<b>127.8</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.6 %	3.0 %	2.4 %	2.5 %
15-35	3.0 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %
36-60	-	4.0 %	2.6 %	3.0 %
61-90	-	3.3 %	2.4 %	3.2 %
91-180	0.0 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
>180	-	3.8 %	3.7 %	3.7 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.9 %</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 intragruo.

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

Sectores	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	33	104	3762	3211	21	137	3338	3401	13	182	2519	2701
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1975	1532	0	0	2036	1151	0	0	1596	1053
<b>Otros</b>	104	33	625	1618	137	21	573	1395	181	13	629	990
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6362</b>	<b>6362</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>5947</b>	<b>5947</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>4744</b>	<b>4744</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.