

**Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2015**

**Fecha de Información: 14 de septiembre 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\$1571.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.<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	393.5	395.2	139.2	130.2	18.5	25.8	237.5
15-35	384.8	364.9	238.5	106.0	60.9	213.3	65.5
36-60	97.3	20.1	0.7	40.0	19.4	57.3	0.0
61-90	2.7	10.9	0.0	0.0	10.9	2.7	0.0
91-180	77.8	50.2	0.1	0.0	50.1	77.8	0.0
>180	52.5	25.0	1.5	40.0	23.5	12.5	0.0
<b>Total</b>	<b>1008.6</b>	<b>866.3</b>	<b>380.0</b>	<b>316.2</b>	<b>183.3</b>	<b>389.4</b>	<b>303.0</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	2.8 %	3.1 %	2.7 %	2.8 %
15-35	2.5 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	4.2 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	4.2 %	3.1 %	4.0 %
91-180	-	4.1 %	3.2 %	3.6 %
>180	-	4.0 %	3.7 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.0 %</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: ((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	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	135	3916	3875	14	184	2943	3009	9	124	2218	2510
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2304	1481	0	0	1664	1180	0	0	1415	789
<b>Otros</b>	135	20	609	1473	184	14	684	1102	124	9	810	1144
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6828</b>	<b>6828</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>5290</b>	<b>5290</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>4444</b>	<b>4444</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.