

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2015

Fecha de Información: 06 de octubre 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\$2201.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	541.1	226.1	69.6	367.0	77.5	95.1	79.0
15-35	837.6	573.7	239.3	275.1	60.5	288.6	273.9
36-60	5.3	64.0	0.0	0.0	63.0	4.3	1.0
61-90	12.9	26.4	0.0	0.0	26.4	12.9	0.0
91-180	50.8	128.1	10.0	0.0	118.1	50.8	0.0
>180	51.8	87.6	0.1	0.0	37.6	1.8	50.0
<b>Total</b>	<b>1499.5</b>	<b>1106.0</b>	<b>319.0</b>	<b>642.1</b>	<b>383.1</b>	<b>453.5</b>	<b>403.9</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	1.9 %	3.7 %	2.9 %	2.9 %
15-35	2.9 %	3.9 %	3.6 %	3.5 %
36-60	4.0 %	4.5 %	3.6 %	4.5 %
61-90	-	4.8 %	4.0 %	4.5 %
91-180	-	4.7 %	4.1 %	4.5 %
>180	4.6 %	4.8 %	4.2 %	4.7 %
<b>Total</b>	<b>3.0 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.5 %</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	5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	118	4338	4136	23	153	2911	2933	10	194	2704	2796
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2352	1637	0	1	1569	695	0	0	1788	787
<b>Otros</b>	118	35	755	1672	153	22	827	1679	194	10	477	1386
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>7445</b>	<b>7445</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5307</b>	<b>5307</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>4969</b>	<b>4969</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.