

Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2015

Fecha de Información: 09 de octubre 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\$1246.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

| Rango        | Sector Financiero** |              | Intragrupa y Off-shore*** |              | Otros Agentes |              | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas       | Compras                   | Ventas       | Compras       | Ventas       |                |
| 3-14         | 344.9               | 302.1        | 140.0                     | 170.8        | 48.1          | 60.1         | 114.0          |
| 15-35        | 314.4               | 305.2        | 230.2                     | 92.0         | 28.5          | 175.9        | 46.5           |
| 36-60        | 9.2                 | 26.0         | 2.0                       | 0.0          | 19.0          | 4.2          | 5.0            |
| 61-90        | 2.8                 | 10.6         | 0.0                       | 0.1          | 10.6          | 2.7          | 0.0            |
| 91-180       | 25.7                | 44.9         | 10.0                      | 0.0          | 29.9          | 20.7         | 5.0            |
| >180         | 21.3                | 29.8         | 0.0                       | 0.0          | 9.8           | 1.3          | 20.0           |
| <b>Total</b> | <b>718.4</b>        | <b>718.6</b> | <b>382.2</b>              | <b>262.9</b> | <b>145.9</b>  | <b>265.1</b> | <b>190.5</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         | 1.5 %              | 3.1 %                        | 2.3 %        | 2.4 %        |
| 15-35        | 2.8 %              | 2.8 %                        | 2.1 %        | 2.5 %        |
| 36-60        | 2.7 %              | 3.6 %                        | 1.8 %        | 3.2 %        |
| 61-90        | -                  | 4.7 %                        | 3.4 %        | 4.4 %        |
| 91-180       | 4.0 %              | 4.7 %                        | 4.0 %        | 4.5 %        |
| >180         | 4.8 %              | 4.9 %                        | 4.7 %        | 4.8 %        |
| <b>Total</b> | <b>2.3 %</b>       | <b>3.2 %</b>                 | <b>2.3 %</b> | <b>2.7 %</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                | 114        | 4907        | 4167        | 26                  | 156        | 3531        | 3362        | 13                  | 209        | 3070        | 3160        |
| <b>Intragruppo y off-shore***</b> | 0                 | 0          | 2361        | 2175        | 0                   | 1          | 1740        | 1022        | 0                   | 0          | 1987        | 975         |
| <b>Otros</b>                      | 114               | 35         | 768         | 1695        | 156                 | 25         | 894         | 1781        | 209                 | 13         | 520         | 1441        |
| <b>Total</b>                      | <b>149</b>        | <b>149</b> | <b>8037</b> | <b>8037</b> | <b>182</b>          | <b>182</b> | <b>6164</b> | <b>6164</b> | <b>222</b>          | <b>222</b> | <b>5577</b> | <b>5577</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.