

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2015

Fecha de Información: 14 de octubre 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\$1977.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	456.6	293.0	77.0	313.3	128.2	55.5	87.9
15-35	603.7	664.3	414.3	125.0	81.1	309.7	169.0
36-60	14.6	28.3	7.0	0.0	21.3	14.6	0.0
61-90	0.9	9.4	0.0	0.0	9.4	0.9	0.0
91-180	64.7	82.2	0.0	0.0	82.2	64.7	0.0
>180	0.4	16.3	10.0	0.0	6.3	0.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1140.7</b>	<b>1093.5</b>	<b>508.3</b>	<b>438.3</b>	<b>328.4</b>	<b>445.6</b>	<b>256.9</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	5.7 %	4.0 %	-1.1 %	1.5 %
15-35	3.6 %	4.0 %	3.4 %	3.7 %
36-60	-	4.3 %	3.5 %	4.0 %
61-90	-	5.3 %	4.0 %	5.2 %
91-180	-	5.0 %	4.4 %	4.7 %
>180	-	4.6 %	4.7 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>3.1 %</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	12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	27	140	4014	3518	17	213	3380	3423	25	114	2681	3133
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	1	1800	1404	0	0	2074	1171	0	0	1662	864
<b>Otros</b>	140	26	902	1794	212	17	632	1492	114	25	797	1143
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>6716</b>	<b>6716</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>6086</b>	<b>6086</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5140</b>	<b>5140</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.