

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2015

Fecha de Información: 15 de octubre de jueves <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\$1899.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.<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	173.8	157.1	84.3	65.0	52.8	88.8	20.0
15-35	758.7	413.9	245.8	313.0	43.2	320.7	125.0
36-60	21.6	36.1	0.0	0.0	16.1	1.6	20.0
61-90	1.4	3.5	0.0	0.0	3.5	1.4	0.0
91-180	251.4	152.4	60.0	100.6	22.4	80.8	70.0
>180	23.6	160.5	95.5	0.0	45.0	3.6	20.0
<b>Total</b>	<b>1230.4</b>	<b>923.7</b>	<b>485.6</b>	<b>478.6</b>	<b>183.1</b>	<b>496.8</b>	<b>255.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	4.6 %	4.1 %	4.4 %
15-35	4.0 %	4.6 %	4.2 %	4.3 %
36-60	4.3 %	4.9 %	3.8 %	4.5 %
61-90	-	5.2 %	4.2 %	4.9 %
91-180	4.8 %	4.9 %	4.5 %	4.7 %
>180	4.9 %	5.0 %	5.0 %	5.0 %
<b>Total</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.4 %</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	141	4040	3525	17	215	3463	3536	26	114	2747	3169
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	1	1800	1424	0	0	2142	1204	0	0	1678	876
<b>Otros</b>	141	26	909	1800	215	17	657	1523	114	26	817	1197
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6748</b>	<b>6748</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>6263</b>	<b>6263</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>5242</b>	<b>5242</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.