

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 20 de noviembre 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\$965.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.<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	217.9	118.3	1.0	108.0	40.3	32.9	77.0
15-35	231.5	272.1	160.0	150.2	59.1	28.3	53.0
36-60	25.6	36.6	7.0	0.0	25.3	21.3	4.3
61-90	73.5	42.0	0.0	0.0	42.0	73.5	0.0
91-180	10.3	59.8	34.0	0.0	25.8	10.3	0.0
>180	4.7	7.3	0.0	0.0	7.3	4.7	0.0
<b>Total</b>	<b>563.5</b>	<b>536.1</b>	<b>202.0</b>	<b>258.2</b>	<b>199.9</b>	<b>171.1</b>	<b>134.3</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	0.4 %	1.2 %	0.0 %	0.3 %
15-35	0.5 %	0.7 %	-0.5 %	0.2 %
36-60	0.6 %	2.3 %	2.3 %	2.2 %
61-90	-	3.0 %	2.1 %	2.4 %
91-180	-	3.8 %	3.4 %	3.8 %
>180	-	5.5 %	4.5 %	5.1 %
<b>Total</b>	<b>0.4 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>0.4 %</b>	<b>1.0 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	143	4770	3755	24	160	3336	3139	13	83	3349	2841
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1982	1841	0	0	1583	954	0	0	1423	1500
<b>Otros</b>	143	26	543	1700	160	24	677	1502	83	13	774	1206
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>7296</b>	<b>7296</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>5596</b>	<b>5596</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>5547</b>	<b>5547</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.