

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$1348.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	326.6	303.6	109.0	106.0	37.4	63.4	157.3
15-35	233.9	268.8	174.8	157.5	24.6	6.9	69.5
36-60	33.2	52.5	0.0	0.0	32.5	13.2	20.0
61-90	142.1	103.5	47.0	0.0	46.5	132.1	10.0
91-180	78.7	20.3	10.0	70.0	10.3	8.7	0.0
>180	32.1	10.1	0.0	0.0	10.1	32.1	0.0
<b>Total</b>	<b>846.6</b>	<b>758.8</b>	<b>340.8</b>	<b>333.5</b>	<b>161.3</b>	<b>256.4</b>	<b>256.8</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	0.7 %	2.2 %	0.8 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.5 %	1.4 %
36-60	1.6 %	2.3 %	1.7 %	2.0 %
61-90	2.2 %	2.6 %	2.0 %	2.2 %
91-180	-	3.8 %	3.4 %	3.5 %
>180	-	5.0 %	4.4 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>1.0 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.8 %</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	30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	95	94	4275	3546	20	188	2237	2164	33	180	3435	3574
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	73	1858	1964	0	0	1178	725	0	0	2092	933
<b>Otros</b>	94	22	809	1432	188	20	511	1036	180	33	673	1692
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>6942</b>	<b>6942</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>3925</b>	<b>3925</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>6200</b>	<b>6200</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.