

Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 03 de diciembre 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\$1362.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	312.0	154.5	72.8	226.4	30.9	34.8	50.8
15-35	304.1	310.8	254.0	219.7	13.3	40.9	43.5
36-60	89.3	55.4	46.5	0.2	8.8	89.2	0.0
61-90	91.6	50.3	10.0	5.3	40.3	86.2	0.0
91-180	4.1	15.4	5.1	0.2	10.4	3.9	0.0
>180	25.7	43.8	31.0	10.0	12.8	15.7	0.0
<b>Total</b>	<b>826.8</b>	<b>630.2</b>	<b>419.4</b>	<b>461.8</b>	<b>116.5</b>	<b>270.7</b>	<b>94.3</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	0.1 %	0.8 %	0.8 %	0.7 %
15-35	0.6 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	-	1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	3.0 %	1.8 %	2.1 %
91-180	-	4.0 %	2.9 %	3.7 %
>180	-	3.9 %	3.8 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>0.3 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.4 %</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	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>	99	98	4415	3673	27	198	2475	2267	32	185	3597	3631
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	73	1928	2036	0	0	1217	888	0	0	2120	1070
<b>Otros</b>	98	26	820	1453	198	27	516	1053	185	32	692	1707
<b>Total</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>7163</b>	<b>7163</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>4208</b>	<b>4208</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>6409</b>	<b>6409</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.