

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 09 de diciembre 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\$1359.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.4%.<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	351.1	199.6	78.9	243.4	25.2	12.1	95.5
15-35	246.4	267.4	224.5	171.6	15.4	47.4	27.5
36-60	115.8	61.9	0.0	0.0	61.9	115.8	0.0
61-90	10.0	54.5	33.6	0.0	20.9	10.0	0.0
91-180	30.4	43.4	30.0	0.0	13.4	30.4	0.0
>180	46.9	54.6	11.2	0.3	43.4	46.6	0.0
<b>Total</b>	<b>800.6</b>	<b>681.5</b>	<b>378.2</b>	<b>415.3</b>	<b>180.3</b>	<b>262.3</b>	<b>123.0</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	0.1 %	1.3 %	-4.5 %	-2.2 %
15-35	0.4 %	1.1 %	0.5 %	0.8 %
36-60	-	1.8 %	0.9 %	1.2 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	2.1 %
91-180	-	3.3 %	2.5 %	3.0 %
>180	-	4.3 %	3.4 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>0.2 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>-0.6 %</b>	<b>0.4 %</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	7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre				21 al 25 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	31	188	2999	2501	35	200	3910	3941	19	106	1138	1665
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1323	1236	0	0	2293	1233	0	0	1008	531
<b>Otros</b>	188	31	536	1120	200	35	693	1723	106	19	180	131
<b>Total</b>	<b>218</b>	<b>218</b>	<b>4858</b>	<b>4858</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>6897</b>	<b>6897</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>2326</b>	<b>2326</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.