

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1160.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.<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	307.1	77.5	42.0	236.5	15.5	50.6	20.0
15-35	297.6	296.3	236.9	66.0	28.4	200.5	31.0
36-60	20.0	22.5	7.3	0.0	15.2	20.0	0.0
61-90	26.8	90.8	29.5	0.0	61.3	26.8	0.0
91-180	15.5	41.6	21.8	0.0	19.7	15.5	0.0
>180	5.7	10.1	7.0	5.0	3.1	0.7	0.0
<b>Total</b>	<b>672.7</b>	<b>538.7</b>	<b>344.5</b>	<b>307.5</b>	<b>143.2</b>	<b>314.2</b>	<b>51.0</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 %	1.1 %	-0.8 %	-0.5 %
15-35	0.4 %	0.8 %	0.5 %	0.6 %
36-60	-	1.9 %	0.8 %	1.3 %
61-90	-	2.9 %	2.0 %	2.7 %
91-180	-	3.9 %	2.8 %	3.6 %
>180	-	4.8 %	3.8 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>0.3 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>0.1 %</b>	<b>0.7 %</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	195	3034	2501	65	193	4120	3999	29	106	1154	1690
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1323	1278	0	0	2323	1422	0	0	1020	536
<b>Otros</b>	195	31	536	1113	193	65	710	1732	106	29	184	131
<b>Total</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>4892</b>	<b>4892</b>	<b>258</b>	<b>258</b>	<b>7153</b>	<b>7153</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>2358</b>	<b>2358</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.