

Fecha de Publicación: 5 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 03 de noviembre 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\$1529.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<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	231.1	173.9	62.5	119.3	51.4	51.8	60.0
15-35	571.5	197.0	95.0	339.9	28.5	158.1	73.5
36-60	21.6	135.0	45.0	0.0	85.0	16.6	5.0
61-90	44.6	18.8	0.0	0.0	18.8	44.6	0.0
91-180	9.9	129.2	13.6	0.0	115.6	9.9	0.0
>180	56.0	125.1	0.0	10.0	79.1	0.0	46.0
<b>Total</b>	<b>934.7</b>	<b>778.9</b>	<b>216.1</b>	<b>469.2</b>	<b>378.3</b>	<b>280.9</b>	<b>184.5</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	4.1 %	4.7 %	3.7 %	4.1 %
15-35	4.1 %	4.7 %	4.6 %	4.6 %
36-60	4.3 %	5.0 %	4.3 %	4.9 %
61-90	-	5.6 %	4.6 %	4.9 %
91-180	-	5.5 %	4.7 %	5.4 %
>180	5.1 %	5.4 %	5.2 %	5.3 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

Sector	2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	158	3395	3121	17	145	2427	2778	16	157	3646	3624
Intragrupa y off-shore***	0	0	1876	1356	0	0	1629	657	0	0	1819	1152
Otros	158	16	425	1218	145	17	579	1200	157	16	799	1488
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>5695</b>	<b>5695</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>4635</b>	<b>4635</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>6264</b>	<b>6264</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.

<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.