

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 06 de noviembre de viernes <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\$1391.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.<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	351.1	189.8	96.9	222.9	27.5	62.8	65.4
15-35	291.8	523.9	348.0	88.8	92.1	119.2	83.8
36-60	20.8	7.3	0.0	0.0	7.3	20.8	0.0
61-90	1.4	40.8	0.0	1.0	40.8	0.4	0.0
91-180	38.4	10.6	0.0	30.0	10.6	8.4	0.0
>180	57.0	7.7	0.0	57.0	7.7	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>760.4</b>	<b>780.1</b>	<b>444.9</b>	<b>399.7</b>	<b>186.0</b>	<b>211.5</b>	<b>149.2</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	0.5 %	0.6 %	-0.6 %	-0.1 %
15-35	0.0 %	1.1 %	0.0 %	0.7 %
36-60	-	2.9 %	0.3 %	1.0 %
61-90	-	4.0 %	2.0 %	3.9 %
91-180	-	4.8 %	3.2 %	3.6 %
>180	-	5.1 %	4.5 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>0.2 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>0.3 %</b>	<b>0.8 %</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**

Sectores	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	154	3659	3167	27	145	2907	2958	18	165	3813	3707
Intragrupa y off-shore***	0	0	1886	1609	0	0	1707	989	0	0	1872	1234
Otros	154	16	460	1229	145	27	632	1298	165	18	783	1528
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6005</b>	<b>6005</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>5245</b>	<b>5245</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>6469</b>	<b>6469</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.