

Fecha de Publicación: 9 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 04 de diciembre 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\$1334.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.<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	318.8	220.2	116.2	192.0	23.0	45.8	81.0
15-35	220.7	341.2	274.3	142.5	6.9	18.2	60.0
36-60	60.1	20.8	3.0	0.0	17.8	60.1	0.0
61-90	86.4	73.7	50.5	0.0	23.2	86.4	0.0
91-180	44.6	47.5	16.0	0.0	31.5	44.6	0.0
>180	28.9	17.8	10.0	5.0	2.8	18.9	5.0
<b>Total</b>	<b>759.5</b>	<b>721.2</b>	<b>469.9</b>	<b>339.5</b>	<b>105.3</b>	<b>274.0</b>	<b>146.0</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	0.3 %	0.7 %	0.1 %	0.4 %
15-35	0.3 %	0.5 %	0.3 %	0.4 %
36-60	-	1.1 %	1.0 %	1.0 %
61-90	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	3.3 %	3.3 %	3.3 %
>180	4.6 %	4.1 %	4.0 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>0.4 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.0 %</b>	<b>0.9 %</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	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
Sector Financiero**	99	94	4415	3674	32	203	2737	2393	31	206	3650	3698
Intragruppo y off-shore***	0	73	1928	2036	0	0	1279	1054	0	0	2174	1096
Otros	94	26	821	1454	203	32	526	1095	206	31	678	1708
<b>Total</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>7164</b>	<b>7164</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>4542</b>	<b>4542</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>6502</b>	<b>6502</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.