

**Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2015**

**Fecha de Información: 30 de octubre 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\$1237.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	193.1	147.8	95.1	148.8	47.7	39.3	5.0
15-35	453.9	287.0	146.7	262.0	79.3	131.0	61.0
36-60	35.3	41.2	0.0	10.0	26.2	10.3	15.0
61-90	4.2	28.2	0.0	0.0	28.2	4.2	0.0
91-180	11.6	46.4	0.1	0.0	36.3	1.6	10.0
>180	15.5	64.3	0.0	15.0	64.3	0.5	0.0
<b>Total</b>	<b>713.6</b>	<b>614.8</b>	<b>241.8</b>	<b>435.7</b>	<b>282.0</b>	<b>186.9</b>	<b>91.0</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	
3-14	3.7 %	5.0 %	3.9 %	4.4 %
15-35	4.1 %	4.6 %	4.2 %	4.4 %
36-60	4.7 %	5.2 %	4.6 %	4.9 %
61-90	-	5.1 %	4.4 %	5.0 %
91-180	4.8 %	5.4 %	4.5 %	5.2 %
>180	-	5.2 %	4.9 %	5.1 %
<b>Total</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.5 %</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	32	157	4081	3914	16	154	3294	3062	15	140	2335	2728
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1986	1661	0	0	1823	1275	0	0	1629	624
Otros	157	32	895	1388	154	16	418	1199	140	15	554	1166
Total	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>6962</b>	<b>6962</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>5535</b>	<b>5535</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>4519</b>	<b>4519</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.