

**Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2015**

**Fecha de Información: 04 de noviembre de miércoles<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\$1639.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<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	427.9	45.1	10.2	363.0	24.9	54.9	10.0
15-35	481.1	595.9	428.0	170.8	24.4	166.8	143.5
36-60	8.8	38.2	8.5	0.0	29.7	8.8	0.0
61-90	4.5	5.4	0.0	0.0	5.4	4.5	0.0
91-180	92.5	19.8	0.0	0.0	9.8	82.5	10.0
>180	49.3	49.9	0.0	25.0	34.9	9.3	15.0
<b>Total</b>	<b>1064.0</b>	<b>754.2</b>	<b>446.7</b>	<b>558.8</b>	<b>129.1</b>	<b>326.7</b>	<b>178.5</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	
3-14	7.3 %	3.7 %	2.2 %	2.5 %
15-35	3.1 %	4.1 %	3.1 %	3.5 %
36-60	-	4.4 %	2.9 %	4.1 %
61-90	-	5.2 %	4.0 %	4.7 %
91-180	4.3 %	5.3 %	4.5 %	4.6 %
>180	5.0 %	5.3 %	4.9 %	5.1 %
<b>Total</b>	<b>3.6 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.5 %</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	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
<b>Sector Financiero**</b>	16	159	3638	3121	21	143	2570	2814	18	162	3693	3638
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1876	1589	0	0	1633	756	0	0	1831	1187
Otros	159	16	425	1229	143	21	601	1234	162	18	801	1501
Total	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5938</b>	<b>5938</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>4804</b>	<b>4804</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>6326</b>	<b>6326</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.