

Fecha de Publicación: 7 de enero de 2016

Fecha de Información: 05 de enero 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\$712.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.<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	137.0	142.7	58.0	59.5	18.9	11.8	65.8
15-35	208.0	245.5	125.8	75.9	9.0	21.4	110.8
36-60	3.6	5.5	0.0	0.0	5.5	3.6	0.0
61-90	3.1	12.7	0.0	0.0	12.7	3.1	0.0
91-180	33.4	13.3	0.0	30.0	11.8	1.9	1.5
>180	55.0	45.2	30.0	0.0	0.2	40.0	15.0
<b>Total</b>	<b>440.2</b>	<b>464.9</b>	<b>213.8</b>	<b>165.4</b>	<b>58.1</b>	<b>81.8</b>	<b>193.0</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	3.7 %	4.0 %	1.8 %	3.6 %
15-35	3.4 %	3.1 %	3.5 %	3.3 %
36-60	-	4.3 %	3.3 %	3.9 %
61-90	-	5.7 %	3.0 %	5.2 %
91-180	4.7 %	4.9 %	4.3 %	4.5 %
>180	5.0 %	5.1 %	4.7 %	4.9 %
<b>Total</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.9 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>3.8 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	4 al 8 de enero				11 al 15 de enero				18 al 22 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	95	1891	2080	27	122	2281	2575	10	136	1833	2017
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1278	910	0	0	1298	626	0	0	1084	283
<b>Otros</b>	95	19	272	450	122	27	692	1071	136	10	479	1097
<b>Total</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>3441</b>	<b>3441</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>4272</b>	<b>4272</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>3397</b>	<b>3397</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.