

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2016

Fecha de Información: 18 de enero de lunes <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\$393.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<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	93.5	79.1	31.0	54.8	15.1	5.7	33.0
15-35	72.0	134.3	79.5	22.5	14.8	9.5	40.0
36-60	63.0	12.6	0.0	24.2	1.6	27.8	11.0
61-90	5.1	1.0	0.0	0.0	1.0	5.1	0.0
91-180	5.2	11.2	0.0	0.0	11.2	5.2	0.0
>180	0.0	0.1	0.0	0.0	0.1	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>238.8</b>	<b>238.3</b>	<b>110.5</b>	<b>101.5</b>	<b>43.8</b>	<b>53.3</b>	<b>84.0</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	1.7 %	5.8 %	4.9 %	4.3 %
15-35	4.2 %	4.8 %	5.4 %	4.7 %
36-60	4.5 %	5.6 %	4.6 %	4.6 %
61-90	-	5.7 %	4.7 %	4.8 %
91-180	-	5.6 %	5.0 %	5.4 %
>180	-	6.6 %	-	6.6 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.6 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	18 al 22 de enero				25 al 29 de enero				1 al 5 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	119	2852	2707	12	122	2347	1796	5	84	1817	2328
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1429	748	0	0	758	429	0	0	1464	547
<b>Otros</b>	119	10	400	1227	122	12	577	1456	84	5	395	801
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4681</b>	<b>4681</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>3682</b>	<b>3682</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>3676</b>	<b>3676</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.