

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2016

Fecha de Información: 22 de enero 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\$1328.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.<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	419.2	254.6	186.8	207.0	21.8	166.2	46.0
15-35	341.3	237.7	151.0	190.3	24.7	89.0	62.0
36-60	4.9	28.0	10.0	0.0	18.0	4.9	0.0
61-90	11.5	18.3	3.0	10.0	15.3	1.5	0.0
91-180	10.6	60.0	20.0	5.0	35.0	0.6	5.0
>180	25.4	44.9	10.0	10.0	19.9	0.4	15.0
<b>Total</b>	<b>812.9</b>	<b>643.4</b>	<b>380.8</b>	<b>422.3</b>	<b>134.7</b>	<b>262.7</b>	<b>128.0</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	5.2 %	3.9 %	4.5 %	4.4 %
15-35	-5.4 %	5.3 %	5.1 %	3.8 %
36-60	-	5.8 %	3.5 %	5.5 %
61-90	-	6.0 %	5.2 %	5.6 %
91-180	5.5 %	5.5 %	5.4 %	5.5 %
>180	5.3 %	5.5 %	5.3 %	5.4 %
<b>Total</b>	<b>0.1 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.3 %</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>	11	133	3429	2852	9	129	2872	2258	6	89	2072	2473
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1515	1226	0	0	1079	668	0	0	1538	700
<b>Otros</b>	133	11	412	1277	129	9	639	1664	89	6	426	863
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5356</b>	<b>5356</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>4590</b>	<b>4590</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>4037</b>	<b>4037</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.