

**Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 28 de enero de jueves <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\$1331.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.<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	277.4	89.0	30.3	184.5	41.8	75.9	17.0
15-35	458.8	372.1	129.8	226.3	145.9	136.1	96.5
36-60	0.8	42.8	9.8	0.0	33.0	0.8	0.0
61-90	31.2	22.2	0.0	0.0	22.2	31.2	0.0
91-180	44.7	93.2	0.0	5.0	83.2	29.7	10.0
>180	6.2	16.7	0.0	0.0	16.7	6.2	0.0
<b>Total</b>	<b>819.2</b>	<b>636.0</b>	<b>169.8</b>	<b>415.8</b>	<b>342.6</b>	<b>279.9</b>	<b>123.5</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	Compras	Ventas	
3-14	3.8 %	3.8 %	3.0 %	3.2 %
15-35	2.7 %	4.8 %	3.5 %	3.8 %
36-60	-	5.1 %	4.3 %	5.0 %
61-90	-	5.3 %	4.5 %	4.8 %
91-180	4.7 %	5.5 %	4.7 %	5.3 %
>180	-	5.4 %	4.4 %	5.2 %
<b>Total</b>	<b>3.0 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.9 %</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	25 al 29 de enero				1 al 5 de febrero				8 al 12 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	109	3383	2439	9	92	2598	2685	30	96	2143	1902
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1116	862	0	0	1664	959	0	0	968	502
<b>Otros</b>	109	11	659	1856	92	9	466	1082	96	30	708	1415
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5157</b>	<b>5157</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>4727</b>	<b>4727</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>3819</b>	<b>3819</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.