

**Fecha de Publicación: 2 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 29 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\$1276.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.<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	205.1	31.7	0.0	129.6	31.7	75.5	0.0
15-35	568.8	542.1	266.8	162.0	65.9	197.4	209.4
36-60	5.4	26.3	10.1	0.2	16.2	5.2	0.0
61-90	19.7	53.1	10.0	15.0	43.1	4.7	0.0
91-180	9.2	16.1	0.0	0.0	16.1	9.2	0.0
>180	5.3	3.4	0.0	0.0	3.4	5.3	0.0
<b>Total</b>	<b>813.4</b>	<b>672.8</b>	<b>286.9</b>	<b>306.8</b>	<b>176.4</b>	<b>297.3</b>	<b>209.4</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 %	3.1 %	3.2 %
15-35	2.2 %	3.0 %	2.3 %	2.5 %
36-60	-	4.5 %	3.1 %	4.2 %
61-90	-	4.8 %	3.9 %	4.5 %
91-180	-	5.4 %	4.6 %	5.1 %
>180	-	5.7 %	4.8 %	5.2 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.9 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	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	108	3383	2440	9	95	2721	2705	31	97	2224	1910
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1116	862	0	0	1664	1052	0	0	968	539
<b>Otros</b>	108	11	659	1856	95	9	486	1113	97	31	716	1459
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>5158</b>	<b>5158</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4870</b>	<b>4870</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>3908</b>	<b>3908</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.