

**Fecha de Publicación: 12 de enero de 2016**

**Fecha de Información: 07 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\$690.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	210.9	138.4	1.5	90.5	41.9	25.4	95.0
15-35	190.0	213.9	153.0	70.8	14.9	73.3	46.0
36-60	4.9	10.5	0.2	0.1	10.4	4.8	0.0
61-90	16.9	14.5	0.1	1.2	4.4	5.7	10.0
91-180	15.6	17.7	0.0	5.0	7.7	0.6	10.0
>180	7.7	10.2	5.0	2.5	5.2	5.2	0.0
<b>Total</b>	<b>446.0</b>	<b>405.3</b>	<b>159.8</b>	<b>170.1</b>	<b>84.5</b>	<b>114.9</b>	<b>161.0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	4.5 %	3.7 %	3.8 %
15-35	3.7 %	4.1 %	3.9 %	4.0 %
36-60	-	4.4 %	3.3 %	4.0 %
61-90	4.3 %	4.8 %	2.8 %	3.9 %
91-180	4.7 %	4.9 %	4.4 %	4.7 %
>180	-	5.0 %	4.6 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>3.8 %</b>	<b>4.3 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>4.0 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

**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>	24	94	2132	2107	55	125	2573	2836	10	138	1964	2077
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1291	1137	0	0	1315	693	0	0	1084	352
<b>Otros</b>	94	24	273	452	125	55	733	1092	138	10	499	1118
<b>Total</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>3696</b>	<b>3696</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>4620</b>	<b>4620</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>3546</b>	<b>3546</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.