

**Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 09 de febrero de martes <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\$1262.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.<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	201.0	196.3	71.0	40.0	35.3	70.9	90.0
15-35	353.0	385.4	199.8	137.3	68.6	98.7	117.0
36-60	36.7	2.6	0.0	0.0	2.6	36.7	0.0
61-90	121.9	46.0	0.0	20.0	6.0	61.9	40.0
91-180	34.5	65.3	0.0	0.0	65.3	34.5	0.0
>180	17.0	49.5	40.0	10.0	9.5	7.0	0.0
<b>Total</b>	<b>764.1</b>	<b>745.1</b>	<b>310.8</b>	<b>207.3</b>	<b>187.3</b>	<b>309.8</b>	<b>247.0</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	1.3 %	5.6 %	4.8 %	3.8 %
15-35	4.2 %	4.7 %	4.1 %	4.4 %
36-60	-	5.0 %	4.3 %	4.4 %
61-90	5.0 %	5.9 %	4.6 %	4.8 %
91-180	-	5.5 %	4.9 %	5.3 %
>180	-	5.2 %	5.4 %	5.3 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.4 %</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	8 al 12 de febrero				15 al 19 de febrero				22 al 26 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	87	2841	2659	13	98	2709	2820	15	128	3390	2734
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1323	781	0	0	1541	783	0	0	1410	1288
<b>Otros</b>	87	39	887	1611	98	13	682	1328	127	15	707	1485
<b>Total</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5051</b>	<b>5051</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>4932</b>	<b>4932</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5507</b>	<b>5507</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.