

**Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 15 de febrero de lunes <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\$237.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.<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	104.4	61.8	0.0	10.4	1.8	34.0	60.0
15-35	7.4	49.8	31.3	5.0	18.5	2.4	0.0
36-60	0.1	7.0	0.0	0.0	7.0	0.1	0.0
61-90	10.4	13.5	3.3	0.0	0.2	0.4	10.0
91-180	6.1	12.6	0.0	0.0	12.6	6.1	0.0
>180	0.5	33.9	10.5	0.0	23.4	0.5	0.0
<b>Total</b>	<b>128.9</b>	<b>178.6</b>	<b>45.1</b>	<b>15.4</b>	<b>63.5</b>	<b>43.5</b>	<b>70.0</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	5.0 %	4.9 %	4.3 %	4.7 %
15-35	-	3.7 %	2.5 %	3.5 %
36-60	-	5.3 %	4.9 %	5.3 %
61-90	4.6 %	5.3 %	4.7 %	4.8 %
91-180	-	6.1 %	5.1 %	5.8 %
>180	-	6.0 %	5.5 %	6.0 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.9 %</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	15 al 19 de febrero				22 al 26 de febrero				29 de feb. al 4 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	97	3181	3126	33	128	3729	2940	4	97	2277	2728
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	3	0	1732	966	0	0	1488	1336	0	0	1643	843
<b>Otros</b>	94	15	667	1487	128	33	756	1697	97	4	405	753
<b>Total</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5580</b>	<b>5580</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>5973</b>	<b>5973</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>4325</b>	<b>4325</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.