

**Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 16 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\$1376.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.<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	324.5	317.6	181.0	74.7	55.6	168.8	81.0
15-35	161.7	209.6	179.0	52.0	23.6	102.7	7.0
36-60	80.8	48.1	0.0	0.0	48.1	80.8	0.0
61-90	42.3	25.4	14.6	0.0	10.8	42.3	0.0
91-180	7.4	4.9	0.0	0.0	4.9	7.4	0.0
>180	169.6	153.3	70.0	85.0	2.3	3.6	81.0
<b>Total</b>	<b>786.3</b>	<b>758.9</b>	<b>444.6</b>	<b>211.7</b>	<b>145.3</b>	<b>405.5</b>	<b>169.0</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 %	5.0 %	4.9 %	5.0 %
15-35	5.0 %	4.7 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	5.3 %	4.4 %	4.7 %
61-90	-	6.0 %	4.7 %	5.0 %
91-180	-	5.7 %	5.1 %	5.3 %
>180	5.5 %	5.4 %	5.4 %	5.4 %
<b>Total</b>	<b>5.2 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.8 %</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	89	3256	3292	38	127	3836	3094	4	97	2418	2741
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	0	1850	1006	0	0	1551	1371	0	0	1653	843
<b>Otros</b>	87	15	691	1500	126	38	789	1711	97	4	407	895
<b>Total</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>5798</b>	<b>5798</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>6176</b>	<b>6176</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>4479</b>	<b>4479</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.