

**Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 17 de febrero de miércoles <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\$1908.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.<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	525.0	219.9	68.0	369.3	119.4	123.2	32.5
15-35	465.2	602.0	355.8	302.8	141.7	58.0	104.5
36-60	10.0	84.6	4.0	0.0	80.6	10.0	0.0
61-90	12.0	22.0	0.0	0.0	12.0	2.0	10.0
91-180	1.7	34.1	10.9	0.0	23.1	1.7	0.0
>180	13.3	65.9	12.0	12.0	53.9	1.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1027.3</b>	<b>1028.5</b>	<b>450.7</b>	<b>684.0</b>	<b>430.7</b>	<b>196.3</b>	<b>147.0</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	4.4 %	5.6 %	5.0 %	5.2 %
15-35	5.4 %	6.1 %	6.8 %	6.2 %
36-60	-	5.3 %	4.8 %	5.2 %
61-90	5.3 %	6.0 %	4.8 %	5.6 %
91-180	-	5.8 %	4.5 %	5.7 %
>180	-	5.8 %	5.5 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>5.2 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.8 %</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>	14	93	3641	3387	37	122	3859	3214	5	97	2545	2751
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	0	1903	1346	0	0	1566	1371	0	0	1653	882
<b>Otros</b>	90	14	706	1518	122	37	889	1728	97	5	418	982
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>6251</b>	<b>6251</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>6313</b>	<b>6313</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>4615</b>	<b>4615</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.