

**Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 19 de febrero de viernes <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\$1360.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.<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	339.7	64.9	15.4	221.1	20.7	89.8	28.8
15-35	259.5	474.0	299.6	124.1	57.4	18.4	117.0
36-60	38.0	4.0	0.0	0.0	4.0	38.0	0.0
61-90	151.7	135.0	40.0	40.0	15.0	31.7	80.0
91-180	0.6	22.7	0.0	0.0	22.7	0.6	0.0
>180	57.8	66.4	35.0	29.1	3.9	1.2	27.5
<b>Total</b>	<b>847.2</b>	<b>767.0</b>	<b>390.0</b>	<b>414.3</b>	<b>123.6</b>	<b>179.6</b>	<b>253.3</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	4.7 %	5.8 %	4.7 %	4.9 %
15-35	5.4 %	5.8 %	5.8 %	5.7 %
36-60	-	6.5 %	5.0 %	5.1 %
61-90	5.4 %	5.5 %	5.4 %	5.4 %
91-180	-	5.9 %	5.2 %	5.9 %
>180	5.8 %	5.7 %	5.8 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.4 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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	88	3683	3412	36	130	4138	3374	5	103	2899	2821
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	0	1921	1380	0	0	1644	1584	0	0	1681	981
<b>Otros</b>	85	14	704	1516	130	36	945	1769	102	5	430	1209
<b>Total</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>6308</b>	<b>6308</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>6726</b>	<b>6726</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>5011</b>	<b>5011</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.