

**Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 23 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\$1079.3 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	268.7	148.6	23.5	97.1	28.1	74.6	97.0
15-35	367.2	271.4	91.7	144.0	42.7	86.2	137.0
36-60	66.9	49.9	0.3	0.0	19.6	36.9	30.0
61-90	47.3	34.0	20.1	0.0	13.9	47.3	0.0
91-180	36.2	14.3	0.2	0.0	14.0	36.2	0.0
>180	0.2	38.6	35.0	0.0	3.6	0.2	0.0
<b>Total</b>	<b>786.5</b>	<b>556.9</b>	<b>170.8</b>	<b>241.1</b>	<b>122.1</b>	<b>281.4</b>	<b>264.0</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	5.6 %	5.1 %	4.4 %	4.9 %
15-35	4.9 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
36-60	4.7 %	5.6 %	4.6 %	4.9 %
61-90	-	5.5 %	4.6 %	5.0 %
91-180	-	5.8 %	4.9 %	5.1 %
>180	-	5.8 %	4.5 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.6 %</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	22 al 26 de febrero				29 de feb. al 4 de marzo				7 al 11 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	33	135	4398	3500	7	127	2988	2904	26	108	1587	1953
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1677	1727	0	0	1731	1014	0	0	1100	608
<b>Otros</b>	135	33	958	1806	127	7	447	1247	108	26	563	689
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>7033</b>	<b>7033</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5166</b>	<b>5166</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>3251</b>	<b>3251</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.