

Fecha de Publicación: 1 de marzo de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1403.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<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	320.3	194.5	112.0	126.3	37.5	149.0	45.0
15-35	355.5	540.2	243.7	140.8	152.6	70.7	144.0
36-60	1.3	25.1	0.0	0.0	25.1	1.3	0.0
61-90	0.8	42.1	20.0	0.0	22.1	0.8	0.0
91-180	3.9	21.6	0.0	0.0	21.6	3.9	0.0
>180	59.8	57.7	20.2	27.3	7.5	2.5	30.0
<b>Total</b>	<b>741.5</b>	<b>881.2</b>	<b>395.9</b>	<b>294.3</b>	<b>266.4</b>	<b>228.2</b>	<b>219.0</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	5.7 %	3.5 %	4.1 %	4.2 %
15-35	5.0 %	4.8 %	4.6 %	4.8 %
36-60	-	5.6 %	4.9 %	5.6 %
61-90	-	5.5 %	4.9 %	5.5 %
91-180	-	6.0 %	5.2 %	5.9 %
>180	5.8 %	5.8 %	5.7 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.7 %</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>	36	117	4669	3656	9	139	3507	3370	31	123	2067	2177
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1758	1900	0	0	1927	1267	0	0	1189	671
<b>Otros</b>	117	36	986	1857	139	9	521	1319	123	31	659	1066
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>7413</b>	<b>7413</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>5955</b>	<b>5955</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>3915</b>	<b>3915</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.