

**Fecha de Publicación: 9 de marzo de 2016**

**Fecha de Información: 07 de marzo de lunes <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\$1833.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<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	409.6	200.7	82.6	287.8	47.6	51.2	70.5
15-35	526.4	368.2	196.4	195.5	32.8	191.9	139.0
36-60	160.0	107.1	15.6	0.0	81.5	150.0	10.0
61-90	1.1	39.7	0.0	0.0	39.7	1.1	0.0
91-180	137.6	145.7	10.0	70.0	75.7	7.6	60.0
>180	2.0	15.1	0.0	0.0	15.1	2.0	0.0
<b>Total</b>	<b>1236.6</b>	<b>876.5</b>	<b>304.7</b>	<b>553.3</b>	<b>292.3</b>	<b>403.8</b>	<b>279.5</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 %	4.1 %	3.2 %	3.7 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.9 %	4.8 %
36-60	4.8 %	5.1 %	4.7 %	4.9 %
61-90	-	5.5 %	4.2 %	5.5 %
91-180	5.6 %	6.1 %	5.4 %	5.8 %
>180	-	6.3 %	5.4 %	6.2 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.6 %</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	7 al 11 de marzo				14 al 18 de marzo				21 al 25 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	159	3378	2902	40	132	3891	3857	3	70	1040	1249
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1439	1426	0	0	2169	1627	0	0	746	496
<b>Otros</b>	159	35	827	1316	132	40	1023	1600	70	3	150	192
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5644</b>	<b>5644</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>7084</b>	<b>7084</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>1936</b>	<b>1936</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.