

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2016

Fecha de Información: 15 de marzo 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\$1446.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.<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	260.2	256.5	61.0	71.0	99.5	93.2	96.0
15-35	491.9	461.3	286.1	126.8	26.8	216.7	148.5
36-60	36.4	72.3	30.0	0.0	42.3	36.4	0.0
61-90	5.9	10.7	0.0	0.0	10.7	5.9	0.0
91-180	52.4	38.9	0.0	15.0	38.9	37.4	0.0
>180	0.6	4.2	0.0	0.0	4.2	0.6	0.0
<b>Total</b>	<b>847.4</b>	<b>843.9</b>	<b>377.1</b>	<b>212.8</b>	<b>222.3</b>	<b>390.2</b>	<b>244.5</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	5.4 %	6.3 %	4.4 %	5.3 %
15-35	5.5 %	5.4 %	5.2 %	5.4 %
36-60	-	5.5 %	4.8 %	5.3 %
61-90	-	6.2 %	5.3 %	5.9 %
91-180	-	6.0 %	5.8 %	5.9 %
>180	-	6.2 %	4.9 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.0 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	14 al 18 de marzo				21 al 25 de marzo				28 de mar. al 1 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	175	4858	4753	3	74	1156	1385	13	163	3821	3051
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2451	2086	0	0	751	497	0	0	1386	1267
<b>Otros</b>	175	40	1300	1769	74	3	204	229	163	13	846	1736
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>8608</b>	<b>8608</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>2111</b>	<b>2111</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>6054</b>	<b>6054</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.