

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2016

Fecha de Información: 17 de marzo de jueves <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\$1859.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<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	187.4	180.7	72.0	75.5	35.7	38.9	73.0
15-35	801.8	375.6	114.0	367.6	130.1	302.7	131.5
36-60	57.7	59.4	0.0	0.0	59.4	57.7	0.0
61-90	33.3	143.0	50.0	5.0	88.0	23.3	5.0
91-180	69.3	72.2	0.0	60.0	72.2	9.3	0.0
>180	28.9	59.1	10.0	20.0	49.1	8.9	0.0
<b>Total</b>	<b>1178.5</b>	<b>890.1</b>	<b>246.0</b>	<b>528.1</b>	<b>434.6</b>	<b>440.8</b>	<b>209.5</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	4.1 %	4.4 %	2.7 %	3.6 %
15-35	4.8 %	5.0 %	4.1 %	4.5 %
36-60	-	5.6 %	4.6 %	5.1 %
61-90	5.0 %	5.5 %	5.1 %	5.5 %
91-180	-	6.2 %	5.4 %	5.8 %
>180	-	6.2 %	5.5 %	6.0 %
<b>Total</b>	<b>4.6 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>4.2 %</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	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	133	4997	4750	2	74	1261	1410	39	220	3994	3266
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2512	2176	0	0	751	575	0	0	1513	1320
<b>Otros</b>	133	40	1161	1743	74	2	207	234	220	39	878	1799
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>8669</b>	<b>8669</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>2219</b>	<b>2219</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>6385</b>	<b>6385</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.