

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2016

Fecha de Información: 01 de febrero de lunes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1552.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	233.2	135.5	47.0	123.1	18.5	40.1	70.0
15-35	548.5	627.4	395.7	143.5	51.7	225.0	180.0
36-60	9.0	38.5	0.0	0.0	38.2	8.7	0.3
61-90	1.5	7.4	0.0	0.0	7.4	1.5	0.0
91-180	93.0	65.3	0.0	0.0	65.3	93.0	0.0
>180	20.4	33.2	20.0	0.0	3.2	10.4	10.0
Total	905.6	907.3	462.7	266.6	184.2	378.7	260.3

* 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	6.1 %	4.1 %	3.9 %	4.4 %
15-35	3.6 %	4.3 %	3.7 %	3.9 %
36-60	3.9 %	4.3 %	3.9 %	4.2 %
61-90	-	4.8 %	4.1 %	4.7 %
91-180	-	5.2 %	5.0 %	5.1 %
>180	4.8 %	4.9 %	5.1 %	4.9 %
Total	4.3 %	4.4 %	4.0 %	4.2 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² 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	1 al 5 de febrero				8 al 12 de febrero				15 al 19 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	95	2964	2761	39	97	2280	1989	11	96	2169	2558
Intragruppo y off-shore***	0	0	1686	1173	0	0	993	541	0	0	1498	589
Otros	95	9	489	1205	97	39	729	1473	96	11	596	1117
Total	105	105	5139	5139	136	136	4002	4002	107	107	4263	4263

* 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.