

Fecha de Publicación: 4 de febrero de 2016

Fecha de Información: 02 de febrero de martes 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\$1179.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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	217.7	109.2	67.0	129.8	11.3	57.0	30.9
15-35	342.5	404.4	312.5	62.2	16.9	205.3	75.0
36-60	6.4	3.9	2.2	1.9	1.7	4.4	0.0
61-90	8.9	4.4	0.0	0.0	4.4	8.9	0.0
91-180	58.6	44.6	0.0	0.0	44.6	58.6	0.0
>180	33.5	68.4	50.7	0.0	0.2	16.0	17.5
Total	667.6	634.9	432.4	193.9	79.1	350.3	123.4

* 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	5.0 %	4.8 %	3.2 %	3.8 %
15-35	4.6 %	4.2 %	4.4 %	4.4 %
36-60	-	5.0 %	2.6 %	3.3 %
61-90	-	5.4 %	3.8 %	4.4 %
91-180	-	5.7 %	4.6 %	5.0 %
>180	5.0 %	5.0 %	4.5 %	4.9 %
Total	4.8 %	4.6 %	4.0 %	4.3 %

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	10	95	3118	2792	41	92	2333	2063	12	95	2245	2591
Intragrupa y off-shore***	0	0	1686	1288	0	0	1060	556	0	0	1526	589
Otros	95	10	494	1217	92	41	732	1507	95	12	601	1193
Total	106	106	5297	5297	133	133	4125	4125	107	107	4372	4372

* 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.