

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2016

Fecha de Información: 04 de febrero de jueves 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\$1358.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.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	338.8	178.6	11.0	169.7	74.6	76.2	93.0
15-35	424.3	311.7	223.4	98.5	17.9	255.3	70.5
36-60	11.2	41.4	30.0	0.0	11.4	11.2	0.0
61-90	0.1	23.0	0.0	0.0	23.0	0.1	0.0
91-180	75.7	49.7	6.0	0.0	29.7	61.7	14.0
>180	59.8	37.1	10.0	20.0	12.1	24.8	15.0
Total	910.0	641.4	280.4	288.2	168.5	429.3	192.5

* 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	3.6 %	4.5 %	3.3 %	3.6 %
15-35	4.5 %	4.5 %	3.5 %	4.0 %
36-60	-	5.1 %	4.0 %	4.8 %
61-90	-	5.3 %	4.4 %	5.3 %
91-180	5.0 %	5.4 %	4.7 %	5.0 %
>180	5.2 %	5.2 %	4.8 %	5.0 %
Total	4.1 %	4.7 %	3.6 %	4.1 %

* 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**	20	93	3382	2863	37	93	2616	2261	12	97	2370	2617
Intragrupa y off-shore***	0	0	1691	1493	0	0	1106	671	0	0	1533	663
Otros	93	20	498	1215	93	37	789	1579	97	12	614	1238
Total	113	113	5571	5571	130	130	4511	4511	109	109	4518	4518

* 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.