

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2016

Fecha de Información: 18 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\$1896.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	325.3	177.7	82.1	106.5	60.6	183.8	35.0
15-35	524.0	426.4	347.8	334.3	51.6	162.8	27.0
36-60	60.3	36.6	0.0	0.0	36.6	60.3	0.0
61-90	62.7	44.2	0.0	15.0	29.2	32.7	15.0
91-180	51.6	85.2	20.0	26.5	65.2	25.1	0.0
>180	124.4	89.3	15.0	87.7	40.2	2.6	34.1
Total	1148.3	859.4	464.9	569.9	283.4	467.2	111.1

* 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	1.3 %	5.3 %	5.4 %	5.1 %
15-35	4.9 %	5.5 %	4.4 %	4.9 %
36-60	-	5.4 %	4.9 %	5.1 %
61-90	5.2 %	5.2 %	5.2 %	5.2 %
91-180	-	5.9 %	5.4 %	5.8 %
>180	5.7 %	5.8 %	5.7 %	5.7 %
Total	4.1 %	5.5 %	4.9 %	5.1 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	15 al 19 de febrero				22 al 26 de febrero				29 de feb. al 4 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	92	3680	3412	37	128	3937	3344	5	101	2761	2790
Intragruppo y off-shore***	3	0	1921	1377	0	0	1629	1417	0	0	1681	927
Otros	90	14	703	1516	128	37	930	1735	101	5	429	1153
Total	107	107	6304	6304	165	165	6495	6495	106	106	4870	4870

* 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.