

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2016

Fecha de Información: 22 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\$1282.6 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	158.3	105.3	59.5	96.0	42.8	59.3	3.0
15-35	381.4	231.0	102.5	173.3	28.0	107.6	100.5
36-60	278.9	66.5	4.0	28.5	32.5	220.4	30.0
61-90	60.2	60.5	10.0	47.6	47.9	10.0	2.6
91-180	12.2	24.1	0.0	0.0	24.1	12.2	0.0
>180	0.0	40.2	0.0	0.0	40.2	0.0	0.0
Total	891.0	527.6	176.0	345.4	215.5	409.6	136.1

* 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	5.0 %	5.8 %	4.8 %	5.3 %
15-35	5.1 %	5.2 %	4.7 %	4.9 %
36-60	5.2 %	5.5 %	4.8 %	4.9 %
61-90	5.3 %	5.6 %	5.3 %	5.4 %
91-180	-	6.0 %	5.5 %	5.8 %
>180	-	5.5 %	5.5 %	5.5 %
Total	5.1 %	5.5 %	4.8 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	22 al 26 de febrero				29 de feb. al 4 de marzo				7 al 11 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	133	4253	3418	5	111	2938	2863	26	112	1477	1899
Intragrupa y off-shore***	0	0	1675	1667	0	0	1710	991	0	0	1100	594
Otros	133	34	958	1801	111	5	444	1237	112	26	531	615
Total	168	168	6886	6886	116	116	5091	5091	138	138	3109	3109

* 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.