

Fecha de Publicación: 29 de febrero de 2016

Fecha de Información: 25 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\$1840.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	406.7	223.7	64.6	110.0	89.8	227.4	69.3
15-35	435.2	284.7	148.6	239.5	37.2	96.7	99.0
36-60	70.1	42.4	0.0	0.0	40.4	68.1	2.0
61-90	223.4	134.4	0.4	0.0	69.0	158.4	65.0
91-180	15.1	170.3	30.0	0.0	125.3	0.1	15.0
>180	60.0	62.9	0.0	10.0	24.4	11.5	38.5
Total	1210.6	918.3	243.5	359.5	386.0	562.3	288.8

* 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	5.3 %	4.4 %	4.9 %	4.8 %
15-35	4.8 %	5.4 %	4.6 %	4.9 %
36-60	5.3 %	5.7 %	4.7 %	5.1 %
61-90	5.3 %	5.9 %	4.6 %	5.0 %
91-180	5.7 %	5.9 %	5.2 %	5.8 %
>180	5.7 %	6.0 %	5.6 %	5.8 %
Total	5.2 %	5.4 %	4.7 %	5.0 %

*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**	36	121	4669	3659	9	129	3323	3209	31	121	1932	2151
Intragrupa y off-shore***	0	0	1758	1900	0	0	1827	1156	0	0	1177	656
Otros	121	36	989	1857	129	9	505	1291	121	31	645	946
Total	157	157	7416	7416	139	139	5655	5655	152	152	3753	3753

* 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.