

Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2016

Fecha de Información: 29 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\$1436.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.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	442.6	272.3	145.9	231.3	58.4	143.4	68.0
15-35	300.5	303.2	166.3	118.0	75.8	121.4	61.1
36-60	44.0	121.0	43.5	0.0	77.5	44.0	0.0
61-90	5.9	30.1	0.0	0.0	30.1	5.9	0.0
91-180	25.7	19.1	0.0	0.0	15.1	21.7	4.0
>180	1.5	3.4	0.0	0.0	3.4	1.5	0.0
Total	820.2	748.9	355.7	349.3	260.2	337.8	133.1

* 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	5.4 %	5.4 %	5.0 %	5.2 %
15-35	5.3 %	5.8 %	5.4 %	5.6 %
36-60	-	5.6 %	4.6 %	5.4 %
61-90	-	5.7 %	5.2 %	5.6 %
91-180	5.7 %	6.0 %	5.3 %	5.6 %
>180	-	6.2 %	5.5 %	6.0 %
Total	5.4 %	5.6 %	5.1 %	5.4 %

* 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	29 de feb. al 4 de marzo				7 al 11 de marzo				14 al 18 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	142	3763	3492	31	124	2152	2313	14	118	3030	3466
Intragrupa y off-shore***	0	0	1998	1469	0	0	1264	697	0	0	2017	1235
Otros	142	9	535	1336	124	31	695	1101	118	14	847	1193
Total	151	151	6297	6297	155	155	4111	4111	133	133	5894	5894

* 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.