

Fecha de Publicación: 3 de marzo de 2016

Fecha de Información: 01 de marzo de martes 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\$2279.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 563.7 | 210.4 | 3.3 | 340.0 | 87.2 | 103.7 | 120.0 |
| 15-35 | 640.4 | 628.2 | 363.6 | 366.3 | 75.6 | 85.2 | 189.0 |
| 36-60 | 192.5 | 172.9 | 31.6 | 0.0 | 64.7 | 115.9 | 76.6 |
| 61-90 | 6.1 | 67.5 | 0.0 | 0.0 | 67.5 | 6.1 | 0.0 |
| 91-180 | 8.0 | 51.7 | 0.0 | 0.0 | 51.7 | 8.0 | 0.0 |
| >180 | 37.7 | 100.8 | 55.0 | 22.4 | 30.8 | 0.3 | 15.0 |
| Total | 1448.4 | 1231.6 | 453.4 | 728.7 | 377.5 | 319.2 | 400.6 |

* 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 | 5.5 % | 5.8 % | 4.5 % | 4.9 % |
| 15-35 | 5.1 % | 1.2 % | 5.2 % | 3.6 % |
| 36-60 | 5.0 % | 5.8 % | 4.8 % | 5.2 % |
| 61-90 | - | 5.8 % | 4.4 % | 5.7 % |
| 91-180 | - | 6.0 % | 5.1 % | 5.9 % |
| >180 | 5.8 % | 5.9 % | 5.8 % | 5.9 % |
| Total | 5.2 % | 3.6 % | 4.9 % | 4.5 % |

*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 | 143 | 4046 | 3553 | 35 | 133 | 2329 | 2430 | 14 | 121 | 3168 | 3556 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1999 | 1695 | 0 | 0 | 1266 | 761 | 0 | 0 | 2041 | 1297 |
| Otros | 143 | 9 | 559 | 1357 | 133 | 35 | 725 | 1128 | 121 | 14 | 887 | 1244 |
| Total | 152 | 152 | 6605 | 6605 | 168 | 168 | 4319 | 4319 | 135 | 135 | 6097 | 6097 |

* 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.