

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2016

Fecha de Información: 02 de marzo de miércoles 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\$2135.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	623.2	212.6	45.7	332.4	100.3	224.3	66.6
15-35	600.9	490.2	294.0	310.3	52.2	146.6	144.1
36-60	3.6	76.1	0.0	0.0	76.1	3.6	0.0
61-90	96.0	75.1	15.0	20.0	45.1	61.0	15.0
91-180	21.4	91.1	0.0	0.0	91.0	21.4	0.0
>180	35.5	60.3	0.0	10.0	35.3	0.5	25.0
Total	1380.7	1005.3	354.6	672.6	400.0	457.4	250.7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.3 %	5.6 %	3.5 %	4.3 %
15-35	5.2 %	6.1 %	4.5 %	5.2 %
36-60	-	5.7 %	4.9 %	5.6 %
61-90	5.2 %	5.8 %	5.0 %	5.3 %
91-180	-	6.0 %	5.3 %	5.9 %
>180	5.8 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
Total	5.8 %	6.0 %	4.1 %	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 intragruppo.

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**	10	144	4226	3596	36	145	2487	2515	40	122	3563	3632
Intragruppo y off-shore***	0	0	1999	1816	0	0	1297	824	0	0	2062	1464
Otros	144	10	575	1388	145	36	740	1185	122	40	942	1472
Total	154	154	6800	6800	181	181	4524	4524	162	162	6568	6568

* 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.