

Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2016

Fecha de Información: 03 de marzo 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\$1924.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	554.3	282.8	160.7	388.3	56.3	100.3	65.8
15-35	434.2	518.6	302.8	282.8	90.6	26.2	125.3
36-60	77.7	71.4	0.0	0.0	46.4	52.7	25.0
61-90	33.0	39.9	0.0	0.0	39.9	33.0	0.0
91-180	41.6	109.0	20.0	0.0	49.0	1.6	40.0
>180	2.0	15.9	0.0	0.0	15.9	2.0	0.0
Total	1142.8	1037.6	483.5	671.0	298.1	215.8	256.0

* 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 %	5.2 %	-4.7 %	-0.8 %
15-35	3.4 %	5.3 %	4.1 %	4.5 %
36-60	5.3 %	5.7 %	4.4 %	5.1 %
61-90	-	6.0 %	4.6 %	5.4 %
91-180	5.8 %	6.0 %	5.4 %	5.9 %
>180	-	6.1 %	5.4 %	6.0 %
Total	4.5 %	5.5 %	-0.8 %	2.6 %

* 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**	10	144	4454	3612	37	145	2714	2623	40	124	3700	3813
Intragrupa y off-shore***	0	0	2007	2024	0	0	1348	994	0	0	2168	1490
Otros	144	10	571	1395	145	37	759	1204	124	40	980	1546
Total	153	153	7032	7032	182	182	4821	4821	164	164	6849	6849

* 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.