

Fecha de Publicación: 8 de marzo de 2016

Fecha de Información: 04 de marzo de viernes 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\$1714.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	444.5	147.7	8.8	281.0	89.9	114.5	49.0
15-35	569.8	419.0	222.0	268.7	47.0	151.1	150.0
36-60	35.2	62.1	0.9	0.0	26.2	0.2	35.0
61-90	7.7	113.0	71.7	0.0	34.3	0.7	7.0
91-180	16.7	79.3	0.0	0.0	64.3	1.7	15.0
>180	47.7	37.9	0.0	0.0	27.9	37.7	10.0
Total	1121.7	859.1	303.4	549.7	289.7	306.0	266.0

* 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	4.7 %	5.0 %	4.3 %	4.5 %
15-35	4.4 %	5.2 %	3.9 %	4.4 %
36-60	5.2 %	5.7 %	3.9 %	5.4 %
61-90	5.4 %	5.5 %	4.6 %	5.5 %
91-180	5.7 %	6.0 %	3.6 %	5.9 %
>180	5.7 %	6.2 %	0.4 %	3.2 %
Total	4.7 %	5.4 %	3.9 %	4.6 %

* 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	140	4454	3612	35	157	3074	2724	40	127	3788	3840
Intragruppo y off-shore***	0	0	2007	2024	0	0	1357	1229	0	0	2168	1536
Otros	140	10	572	1395	157	35	802	1279	127	40	1007	1588
Total	150	150	7032	7032	192	192	5233	5233	167	167	6963	6963

* 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.