

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2016

Fecha de Información: 10 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\$1268.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	172.4	250.4	112.5	33.5	34.9	35.9	103.0
15-35	542.2	261.2	156.6	141.0	32.6	329.2	72.0
36-60	17.7	43.4	0.0	0.0	43.4	17.7	0.0
61-90	37.1	16.3	12.5	0.0	3.8	37.1	0.0
91-180	67.0	27.9	0.0	37.0	7.9	10.0	20.0
>180	12.2	15.2	10.0	11.4	5.2	0.8	0.0
Total	848.6	614.5	291.6	222.9	127.9	430.7	195.0

* 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	5.3 %	4.3 %	4.2 %	4.6 %
15-35	5.1 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %
36-60	-	5.6 %	4.9 %	5.4 %
61-90	-	5.8 %	4.2 %	4.7 %
91-180	5.6 %	6.6 %	5.5 %	5.6 %
>180	-	5.9 %	5.5 %	5.7 %
Total	5.2 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %

* 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	7 al 11 de marzo				14 al 18 de marzo				21 al 25 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	118	3851	3138	41	168	4241	4325	3	71	1095	1331
Intragruppo y off-shore***	0	0	1527	1738	0	0	2333	1752	0	0	751	497
Otros	118	31	832	1335	168	41	1162	1660	71	3	178	195
Total	149	149	6211	6211	209	209	7736	7736	74	74	2023	2023

* 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.