

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2016

Fecha de Información: 11 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\$1297.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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	295.3	205.7	25.3	143.8	49.0	20.0	131.5
15-35	534.8	401.0	195.0	195.0	17.5	151.3	188.5
36-60	28.9	18.4	0.0	0.0	8.4	18.9	10.0
61-90	36.3	57.2	6.0	0.0	21.2	6.3	30.0
91-180	1.0	34.2	10.2	0.0	24.0	1.0	0.0
>180	26.3	37.8	0.0	0.0	17.8	6.3	20.0
Total	922.6	754.4	236.5	338.8	138.0	203.9	380.0

* 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	5.5 %	6.0 %	5.8 %	5.7 %
15-35	4.6 %	5.7 %	4.8 %	5.0 %
36-60	5.0 %	6.5 %	5.0 %	5.3 %
61-90	5.3 %	5.9 %	5.3 %	5.6 %
91-180	-	5.9 %	5.4 %	5.9 %
>180	5.8 %	6.6 %	5.5 %	6.1 %
Total	5.1 %	5.8 %	5.1 %	5.3 %

*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	106	3851	3137	41	173	4532	4516	3	72	1099	1335
Intragrupa y off-shore***	0	0	1527	1738	0	0	2359	1896	0	0	751	497
Otros	106	31	831	1335	173	41	1197	1676	72	3	182	200
Total	137	137	6209	6209	214	214	8088	8088	75	75	2032	2032

* 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.