

Fecha de Publicación: 9 de febrero de 2016

Fecha de Información: 05 de febrero 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\$862.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	196.1	187.8	109.3	121.5	48.5	44.6	30.0
15-35	173.4	206.5	159.1	106.3	21.5	41.2	26.0
36-60	11.9	9.0	0.1	0.0	9.0	11.9	0.0
61-90	47.9	21.4	15.0	0.0	6.4	47.9	0.0
91-180	2.0	7.9	0.2	0.0	7.7	2.0	0.0
>180	30.0	29.5	20.0	20.0	4.5	5.0	5.0
Total	461.2	462.2	303.5	247.8	97.7	152.4	61.0

* 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	3.7 %	4.1 %	3.4 %	3.8 %
15-35	2.0 %	4.2 %	3.6 %	3.7 %
36-60	-	5.0 %	3.9 %	4.4 %
61-90	-	4.9 %	3.9 %	4.2 %
91-180	-	5.7 %	3.3 %	5.2 %
>180	5.2 %	5.2 %	5.0 %	5.1 %
Total	3.1 %	4.3 %	3.6 %	3.9 %

* 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	1 al 5 de febrero				8 al 12 de febrero				15 al 19 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	91	3383	2863	38	89	2726	2409	12	97	2452	2656
Intragrupa y off-shore***	0	0	1691	1493	0	0	1206	738	0	0	1543	717
Otros	91	20	498	1216	89	38	817	1601	97	12	634	1256
Total	111	111	5572	5572	127	127	4748	4748	109	109	4630	4630

* 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.