

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2016

Fecha de Información: 08 de febrero de lunes 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\$1059.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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	255.5	235.3	33.8	84.5	100.5	70.0	101.0
15-35	227.0	408.6	242.8	92.0	72.9	42.0	93.0
36-60	8.3	30.0	0.0	0.0	30.0	8.3	0.0
61-90	59.4	1.1	0.0	42.9	1.1	16.5	0.0
91-180	1.4	4.2	0.0	0.0	4.2	1.4	0.0
>180	6.7	16.3	0.0	0.0	16.3	6.7	0.0
Total	558.3	695.6	276.6	219.4	225.0	144.9	194.0

* 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	4.2 %	4.1 %	3.7 %	4.0 %
15-35	4.1 %	4.5 %	4.2 %	4.4 %
36-60	-	4.8 %	3.8 %	4.6 %
61-90	-	5.3 %	4.8 %	4.8 %
91-180	-	5.5 %	4.7 %	5.3 %
>180	-	5.5 %	4.9 %	5.3 %
Total	4.2 %	4.5 %	4.0 %	4.3 %

*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	8 al 12 de febrero				15 al 19 de febrero				22 al 26 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	89	2769	2521	13	98	2659	2770	14	128	3264	2664
Intragrupa y off-shore***	0	0	1239	761	0	0	1543	777	0	0	1410	1274
Otros	89	38	882	1609	98	13	659	1315	127	14	688	1423
Total	127	127	4891	4891	111	111	4862	4862	142	142	5362	5362

* 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.