

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2016

Fecha de Información: 10 de febrero de miércoles 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\$1474.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	353.8	133.2	24.3	164.6	84.5	164.7	24.5
15-35	428.8	502.4	353.2	209.6	67.1	137.2	82.0
36-60	12.2	40.4	30.0	0.0	5.4	7.2	5.0
61-90	32.1	16.8	0.0	0.0	10.8	26.1	6.0
91-180	19.3	16.4	0.0	0.0	16.4	19.3	0.0
>180	2.7	34.3	30.7	0.0	3.7	2.7	0.0
Total	848.9	743.6	438.2	374.2	187.9	357.2	117.5

* 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	4.0 %	4.4 %	4.1 %	4.2 %
15-35	4.2 %	4.4 %	3.9 %	4.1 %
36-60	4.7 %	4.4 %	4.2 %	4.4 %
61-90	5.0 %	5.7 %	4.5 %	4.9 %
91-180	-	5.5 %	4.6 %	5.0 %
>180	-	5.4 %	5.0 %	5.4 %
Total	4.2 %	4.5 %	4.0 %	4.2 %

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	88	2999	2751	14	98	2850	2885	20	127	3514	2791
Intragrupa y off-shore***	0	0	1325	907	3	0	1546	812	0	0	1425	1300
Otros	88	38	967	1633	96	14	738	1436	127	20	710	1558
Total	126	126	5291	5291	112	112	5134	5134	147	147	5649	5649

* 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.