

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2016

Fecha de Información: 11 de febrero 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\$1480.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	185.3	239.5	158.5	25.1	55.0	134.2	26.0
15-35	352.5	457.6	349.0	151.0	25.8	118.7	82.8
36-60	46.3	12.0	0.0	0.0	12.0	46.3	0.0
61-90	39.9	55.6	0.0	0.0	55.6	39.9	0.0
91-180	15.2	96.3	10.0	10.0	86.3	5.2	0.0
>180	36.1	69.7	40.0	7.5	12.7	11.6	17.0
Total	675.2	930.7	557.5	193.6	247.4	355.8	125.8

* 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	4.7 %	4.8 %	4.2 %	4.5 %
15-35	4.7 %	3.9 %	4.0 %	4.0 %
36-60	-	5.0 %	4.2 %	4.4 %
61-90	-	5.4 %	4.4 %	4.9 %
91-180	-	5.4 %	4.3 %	5.4 %
>180	5.1 %	5.3 %	4.7 %	5.2 %
Total	4.7 %	4.5 %	4.1 %	4.4 %

* 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	94	3038	2767	15	97	2884	3024	30	128	3632	2876
Intragrupa y off-shore***	0	0	1325	936	3	0	1653	812	0	0	1477	1309
Otros	94	38	983	1643	94	15	753	1454	127	30	733	1657
Total	132	132	5347	5347	112	112	5291	5291	158	158	5841	5841

* 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.