

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2016

Fecha de Información: 12 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\$1002.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.2%.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	298.9	223.4	89.8	170.3	53.6	48.6	80.0
15-35	231.8	258.5	171.1	100.8	40.4	84.0	47.0
36-60	21.1	5.4	0.0	0.0	5.4	21.1	0.0
61-90	39.5	19.6	0.0	0.0	19.6	39.5	0.0
91-180	0.9	19.9	2.3	0.0	17.7	0.9	0.0
>180	3.3	7.4	0.0	0.0	7.4	3.3	0.0
Total	595.5	534.2	263.1	271.1	144.1	197.4	127.0

* 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 %	5.0 %	4.1 %	4.3 %
15-35	5.4 %	5.9 %	6.5 %	6.1 %
36-60	-	5.2 %	4.5 %	4.7 %
61-90	-	5.3 %	4.5 %	4.7 %
91-180	-	5.7 %	3.8 %	5.6 %
>180	-	5.7 %	5.0 %	5.5 %
Total	4.3 %	5.5 %	5.2 %	5.2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	8 al 12 de febrero												15 al 19 de febrero				22 al 26 de febrero			
	Delivery				NDF				Delivery				NDF							
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	33	93	3043	2766	14	98	3121	3116	32	128	3689	2931								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1325	936	3	0	1732	955	0	0	1488	1336								
Otros	93	33	982	1648	95	14	707	1488	128	32	756	1666								
Total	126	126	5350	5350	112	112	5559	5559	160	160	5933	5933								

* 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.

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.