

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2016

Fecha de Información: 24 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\$2058.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	469.9	339.9	155.0	234.5	31.9	82.4	153.0
15-35	511.9	714.7	497.3	263.0	82.9	114.4	134.5
36-60	112.5	80.0	0.0	15.0	45.0	62.5	35.0
61-90	23.2	5.0	0.0	0.0	5.0	23.2	0.0
91-180	6.1	16.1	0.0	0.0	16.1	6.1	0.0
>180	45.9	85.9	40.0	10.0	15.9	5.9	30.0
Total	1169.5	1241.6	692.3	522.5	196.8	294.5	352.5

* 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	3.9 %	6.7 %	1.4 %	3.6 %
15-35	5.4 %	5.7 %	5.1 %	5.5 %
36-60	5.4 %	5.2 %	4.9 %	5.1 %
61-90	-	5.5 %	4.8 %	4.9 %
91-180	-	5.7 %	5.3 %	5.6 %
>180	5.8 %	5.8 %	5.5 %	5.7 %
Total	4.8 %	5.9 %	3.6 %	4.9 %

*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	22 al 26 de febrero				29 de feb. al 4 de marzo				7 al 11 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	124	4640	3571	7	131	3179	3122	26	121	1687	2089
Intragrupa y off-shore***	0	0	1697	1895	0	0	1824	1073	0	0	1165	616
Otros	123	33	966	1837	131	7	462	1271	121	26	619	766
Total	157	157	7304	7304	138	138	5465	5465	147	147	3471	3471

* 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.