

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2016

Fecha de Información: 08 de marzo de martes 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\$1820.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.2%.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	335.4	346.7	103.3	150.8	85.5	26.7	158.0
15-35	505.3	632.4	328.2	152.8	59.2	107.5	245.0
36-60	45.7	63.0	10.0	0.0	48.0	40.7	5.0
61-90	10.9	23.5	0.0	0.0	23.5	10.9	0.0
91-180	106.5	102.0	0.0	73.0	76.9	8.5	25.0
>180	50.1	42.3	20.0	40.0	12.3	0.1	10.0
Total	1053.9	1209.9	461.5	416.6	305.4	194.3	443.0

* 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	4.4 %	4.5 %	3.6 %	4.2 %
15-35	6.6 %	4.9 %	4.8 %	5.4 %
36-60	5.3 %	6.9 %	4.4 %	5.8 %
61-90	-	5.6 %	5.0 %	5.4 %
91-180	5.7 %	6.0 %	5.6 %	5.8 %
>180	5.8 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
Total	5.7 %	5.2 %	4.7 %	5.2 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	7 al 11 de marzo				14 al 18 de marzo				21 al 25 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	156	3564	3062	40	130	4041	4040	3	70	1040	1264
Intragrupa y off-shore***	0	0	1509	1523	0	0	2203	1681	0	0	746	496
Otros	156	34	835	1322	130	40	1098	1621	70	3	165	192
Total	189	189	5908	5908	170	170	7341	7341	73	73	1952	1952

* 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.