

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2016

Fecha de Información: 09 de marzo 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\$1537.3 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	370.1	203.0	41.8	253.5	64.3	19.6	97.0
15-35	393.4	474.5	298.5	122.8	84.0	178.6	92.0
36-60	37.5	69.3	0.0	0.0	69.3	37.5	0.0
61-90	4.6	10.2	0.0	0.0	10.2	4.6	0.0
91-180	87.5	35.5	0.0	57.8	25.5	19.7	10.0
>180	38.4	27.5	0.0	22.2	12.5	1.2	15.0
Total	931.3	819.9	340.3	456.2	265.7	261.1	214.0

* 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	3.8 %	4.6 %	-2.3 %	1.0 %
15-35	9.1 %	5.0 %	5.1 %	5.6 %
36-60	-	5.7 %	4.7 %	5.3 %
61-90	-	5.9 %	5.1 %	5.7 %
91-180	5.6 %	6.1 %	4.3 %	4.9 %
>180	5.8 %	6.3 %	5.8 %	5.9 %
Total	6.3 %	5.1 %	2.6 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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**	31	120	3788	3084	40	170	4173	4177	3	70	1055	1285
Intragruppo y off-shore***	0	0	1510	1711	0	0	2238	1746	0	0	751	497
Otros	120	31	824	1327	170	40	1147	1635	70	3	169	192
Total	151	151	6122	6122	211	211	7558	7558	74	74	1974	1974

* 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.