

Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2016

Fecha de Información: 14 de marzo de lunes 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\$1498.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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	266.4	198.9	63.0	119.5	81.9	93.0	54.0
15-35	355.8	457.3	190.7	73.0	115.9	132.2	150.6
36-60	103.2	76.0	0.0	0.0	36.0	63.2	40.0
61-90	31.7	21.1	0.0	0.0	21.1	31.7	0.0
91-180	41.8	73.3	20.0	0.0	53.3	41.8	0.0
>180	50.8	67.2	0.0	10.0	67.2	40.8	0.0
Total	849.7	893.7	273.8	202.5	375.4	402.6	244.6

* 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	5.5 %	5.3 %	4.3 %	4.8 %
15-35	5.3 %	5.6 %	5.0 %	5.3 %
36-60	5.5 %	5.4 %	4.8 %	5.1 %
61-90	-	5.6 %	4.7 %	5.1 %
91-180	-	5.8 %	5.7 %	5.7 %
>180	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
Total	5.3 %	5.6 %	4.9 %	5.3 %

* 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	14 al 18 de marzo				21 al 25 de marzo				28 de mar. al 1 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	173	4786	4691	3	73	1116	1349	11	164	3554	2808
Intragruppo y off-shore***	0	0	2400	2015	0	0	751	497	0	0	1303	1229
Otros	173	42	1291	1770	73	3	188	210	164	11	761	1581
Total	215	215	8476	8476	76	76	2055	2055	175	175	5617	5617

* 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.