

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2016

Fecha de Información: 16 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\$1215.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.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	196.1	122.6	54.1	125.5	11.5	13.6	57.0
15-35	388.1	352.5	193.8	100.1	110.6	239.9	48.1
36-60	6.5	60.2	15.0	0.0	45.2	6.5	0.0
61-90	76.4	41.8	0.0	9.5	21.8	46.9	20.0
91-180	5.2	38.7	0.0	0.0	38.7	5.2	0.0
>180	37.8	24.9	0.0	24.0	14.9	3.8	10.0
Total	710.1	640.6	262.9	259.1	242.6	315.8	135.1

* 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	5.8 %	5.1 %	6.3 %	5.8 %
15-35	5.8 %	5.7 %	4.6 %	5.1 %
36-60	-	5.8 %	5.3 %	5.7 %
61-90	5.6 %	6.1 %	5.1 %	5.5 %
91-180	-	6.1 %	5.4 %	6.0 %
>180	6.0 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
Total	5.8 %	5.7 %	5.0 %	5.4 %

*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**	40	136	4857	4715	2	74	1252	1402	39	205	3918	3179
Intragruppo y off-shore***	0	0	2510	2111	0	0	751	571	0	0	1443	1293
Otros	136	40	1198	1738	74	2	201	231	205	39	862	1750
Total	176	176	8565	8565	76	76	2205	2205	244	244	6223	6223

* 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.