

Fecha de Publicación: 6 de enero de 2016

Fecha de Información: 04 de enero 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\$487.7 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	113.0	134.9	81.8	60.5	19.1	18.5	34.0
15-35	150.8	105.3	71.0	120.5	19.3	15.3	15.0
36-60	1.0	14.6	0.0	0.0	14.6	1.0	0.0
61-90	5.1	6.0	0.0	0.0	6.0	5.1	0.0
91-180	0.4	5.2	0.0	0.0	5.2	0.4	0.0
>180	0.2	0.2	0.0	0.0	0.2	0.2	0.0
Total	270.6	266.2	152.8	181.0	64.4	40.6	49.0

* 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	4.0 %	4.9 %	4.0 %	4.4 %
15-35	3.8 %	4.8 %	3.1 %	3.8 %
36-60	-	5.6 %	3.8 %	5.5 %
61-90	-	5.0 %	4.8 %	4.9 %
91-180	-	6.2 %	4.5 %	6.0 %
>180	-	5.8 %	2.3 %	4.1 %
Total	3.9 %	5.0 %	3.5 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de enero				11 al 15 de enero				18 al 22 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	94	1812	1990	26	121	2245	2532	10	138	1792	1972
Intragruppo y off-shore***	0	0	1223	855	0	0	1295	626	0	0	1078	278
Otros	94	13	261	451	121	26	684	1067	138	10	474	1094
Total	107	107	3296	3296	147	147	4225	4225	148	148	3344	3344

* 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.