

Fecha de Publicación: 8 de enero de 2016

Fecha de Información: 06 de enero 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\$1466.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	431.8	190.0	27.3	249.0	25.7	45.8	137.0
15-35	343.0	456.7	397.0	232.0	10.7	61.9	49.0
36-60	49.4	80.7	20.0	0.0	24.7	13.4	36.0
61-90	3.6	1.6	0.0	0.0	1.6	3.6	0.0
91-180	1.7	57.1	55.0	0.0	2.1	1.7	0.0
>180	1.3	71.5	69.5	0.0	2.0	1.3	0.0
Total	830.8	857.7	568.8	481.0	66.9	127.7	222.0

* 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	3.9 %	3.8 %	2.2 %	3.0 %
15-35	3.9 %	3.8 %	3.5 %	3.7 %
36-60	4.0 %	4.4 %	2.8 %	4.0 %
61-90	-	5.4 %	4.2 %	4.6 %
91-180	-	4.8 %	4.2 %	4.7 %
>180	-	4.8 %	3.9 %	4.7 %
Total	3.9 %	4.1 %	2.9 %	3.6 %

*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**	24	94	2101	2106	40	123	2416	2705	10	135	1954	2073
Intragruppo y off-shore***	0	0	1291	1106	0	0	1313	639	0	0	1084	346
Otros	94	24	272	451	123	40	699	1084	135	10	495	1114
Total	119	119	3663	3663	164	164	4429	4429	146	146	3533	3533

* 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.