

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2016

Fecha de Información: 08 de enero de viernes 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\$987.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	243.8	204.7	67.0	130.0	46.2	22.3	91.5
15-35	242.0	399.2	251.1	111.5	53.7	36.0	94.5
36-60	9.7	1.8	0.0	0.0	1.8	9.7	0.0
61-90	17.7	5.0	0.0	0.0	5.0	17.7	0.0
91-180	26.8	4.7	0.0	15.0	4.7	11.8	0.0
>180	0.0	18.3	15.0	0.0	3.3	0.0	0.0
Total	539.9	633.7	333.1	256.5	114.6	97.4	186.0

* 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	3.1 %	4.5 %	0.4 %	2.6 %
15-35	1.9 %	3.5 %	3.4 %	3.1 %
36-60	-	4.3 %	3.7 %	3.8 %
61-90	-	4.8 %	3.4 %	3.7 %
91-180	-	5.0 %	4.3 %	4.5 %
>180	-	5.1 %	-	5.1 %
Total	2.5 %	3.9 %	2.2 %	3.0 %

*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	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	93	2132	2107	55	129	2772	2991	10	140	2006	2101
Intragruppo y off-shore***	0	0	1291	1137	0	0	1362	793	0	0	1104	382
Otros	93	24	273	452	129	55	749	1099	140	10	502	1130
Total	117	117	3696	3696	184	184	4883	4883	150	150	3613	3613

* 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.