

Fecha de Publicación: 19 de enero de 2016

Fecha de Información: 15 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\$1379.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.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	379.6	334.2	119.0	100.2	21.7	85.9	193.5
15-35	343.7	368.8	285.0	13.4	24.1	270.6	59.7
36-60	90.2	15.4	0.0	2.0	15.4	88.2	0.0
61-90	29.6	9.9	0.0	0.0	4.9	24.6	5.0
91-180	17.2	17.2	0.0	15.0	17.2	2.2	0.0
>180	31.7	0.7	0.0	30.0	0.7	1.7	0.0
Total	891.9	746.2	404.0	160.6	84.0	473.1	258.2

* 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	5.1 %	5.1 %	4.0 %	4.7 %
15-35	5.7 %	5.1 %	4.4 %	4.8 %
36-60	-	5.0 %	4.5 %	4.5 %
61-90	5.0 %	5.6 %	4.7 %	4.9 %
91-180	-	5.4 %	4.5 %	4.9 %
>180	-	6.2 %	5.1 %	5.1 %
Total	5.3 %	5.1 %	4.3 %	4.8 %

*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	11 al 15 de enero				18 al 22 de enero				25 al 29 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	129	3062	3100	11	136	2805	2646	12	122	2322	1779
Intragrupa y off-shore***	0	0	1453	1038	0	0	1398	729	0	0	758	412
Otros	129	55	748	1124	136	11	401	1229	122	12	563	1452
Total	184	184	5262	5262	148	148	4604	4604	134	134	3643	3643

* 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.