

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2016

Fecha de Información: 19 de enero de martes 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\$1773.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	328.7	160.1	112.0	290.2	38.1	28.5	10.0
15-35	451.3	529.8	408.6	148.1	22.2	204.1	99.0
36-60	4.4	27.8	0.2	0.1	27.6	4.3	0.0
61-90	3.0	18.2	13.2	0.0	5.1	3.0	0.0
91-180	71.2	173.0	70.0	0.0	93.0	61.2	10.0
>180	64.8	120.1	52.5	0.0	7.6	4.8	60.0
Total	923.4	1029.0	656.5	438.5	193.6	306.0	179.0

* 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	5.3 %	5.6 %	1.9 %	3.4 %
15-35	5.4 %	5.8 %	5.2 %	5.5 %
36-60	-	6.0 %	4.8 %	5.8 %
61-90	-	6.2 %	5.2 %	6.0 %
91-180	5.4 %	5.6 %	4.8 %	5.4 %
>180	5.4 %	5.4 %	5.1 %	5.4 %
Total	5.4 %	5.7 %	4.1 %	5.0 %

*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	18 al 22 de enero				25 al 29 de enero				1 al 5 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	135	3132	2744	12	125	2383	1882	5	84	1841	2359
Intragrupa y off-shore***	0	0	1470	1014	0	0	824	453	0	0	1475	557
Otros	135	11	396	1240	125	12	597	1468	84	5	405	805
Total	146	146	4998	4998	137	137	3803	3803	90	90	3721	3721

* 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.