

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2016

Fecha de Información: 20 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\$1361.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	238.2	159.6	111.0	176.0	23.0	36.6	25.6
15-35	354.9	350.8	214.0	175.9	95.8	138.1	41.0
36-60	7.8	64.0	40.0	0.0	24.0	7.8	0.0
61-90	15.9	5.0	0.0	2.0	5.0	13.9	0.0
91-180	69.6	39.5	17.7	0.0	21.7	69.6	0.0
>180	36.1	86.1	71.5	30.8	14.6	5.3	0.0
Total	722.6	705.1	454.2	384.6	184.2	271.4	66.6

* 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	4.1 %	5.6 %	3.1 %	4.4 %
15-35	3.1 %	6.6 %	6.0 %	6.1 %
36-60	-	5.9 %	4.8 %	5.7 %
61-90	-	5.7 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.8 %	5.1 %	5.3 %
>180	-	5.4 %	5.4 %	5.4 %
Total	3.5 %	6.1 %	5.2 %	5.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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	137	3320	2811	12	124	2442	1988	5	86	1918	2379
Intragrupa y off-shore***	0	0	1515	1179	0	0	919	494	0	0	1479	610
Otros	137	11	404	1249	124	12	607	1487	86	5	410	818
Total	148	148	5239	5239	136	136	3969	3969	91	91	3807	3807

* 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.

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.