

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2016

Fecha de Información: 21 de enero de jueves 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\$1568.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	275.5	155.0	32.4	104.0	36.6	85.5	86.0
15-35	648.5	353.3	258.0	122.9	71.2	501.5	24.1
36-60	2.1	24.1	1.5	0.0	22.6	2.1	0.0
61-90	24.1	28.9	2.0	0.0	26.9	24.1	0.0
91-180	21.1	109.1	10.0	10.0	89.1	1.1	10.0
>180	16.3	40.5	10.0	0.0	20.5	6.3	10.0
Total	987.6	710.9	313.9	236.9	266.9	620.6	130.1

* 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	8.1 %	5.9 %	4.3 %	5.6 %
15-35	5.7 %	5.8 %	5.1 %	5.4 %
36-60	-	5.9 %	4.8 %	5.8 %
61-90	-	6.5 %	5.2 %	5.9 %
91-180	5.3 %	5.8 %	5.6 %	5.8 %
>180	5.3 %	5.6 %	5.1 %	5.4 %
Total	7.3 %	5.9 %	5.0 %	5.5 %

*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	134	3429	2852	9	128	2555	2064	6	87	1971	2415
Intragruppo y off-shore***	0	0	1515	1226	0	0	937	538	0	0	1493	622
Otros	134	11	412	1277	128	9	622	1512	87	6	423	850
Total	145	145	5355	5355	138	138	4114	4114	92	92	3887	3887

* 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.