

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2016

Fecha de Información: 25 de enero de lunes 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\$1112.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	304.6	112.9	14.5	88.5	22.4	140.1	76.0
15-35	429.2	263.1	149.3	73.5	38.9	280.7	75.0
36-60	16.6	17.4	0.0	0.0	17.4	16.6	0.0
61-90	1.3	2.4	0.0	0.0	2.4	1.3	0.0
91-180	20.9	54.6	0.0	0.0	44.6	10.9	10.0
>180	45.4	30.3	0.0	0.0	5.3	20.4	25.0
Total	817.9	480.7	163.8	162.0	130.9	469.9	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	3.9 %	5.0 %	4.0 %	4.1 %
15-35	5.6 %	5.1 %	5.1 %	5.2 %
36-60	-	5.7 %	7.9 %	6.8 %
61-90	-	5.6 %	4.6 %	5.2 %
91-180	4.9 %	5.6 %	5.1 %	5.4 %
>180	5.4 %	5.5 %	5.0 %	5.2 %
Total	4.8 %	5.2 %	4.8 %	4.9 %

*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	25 al 29 de enero				1 al 5 de febrero				8 al 12 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	128	3117	2350	6	89	2131	2490	21	92	1948	1753
Intragruppo y off-shore***	0	0	1092	741	0	0	1539	715	0	0	885	450
Otros	128	10	651	1769	89	6	432	897	92	21	657	1287
Total	139	139	4861	4861	95	95	4102	4102	113	113	3490	3490

* 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.