

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2016

Fecha de Información: 27 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\$1146.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	267.7	142.9	70.8	75.1	22.2	142.6	50.0
15-35	375.9	258.8	155.0	199.5	41.8	114.4	62.0
36-60	16.0	21.7	0.0	0.0	21.7	16.0	0.0
61-90	20.8	6.1	0.0	4.0	4.6	15.3	1.5
91-180	67.4	6.3	0.0	0.0	6.3	67.4	0.0
>180	10.8	71.6	60.0	0.0	5.6	4.8	6.0
Total	758.5	507.3	285.8	278.6	102.1	360.4	119.5

* 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	5.2 %	5.4 %	4.5 %	4.8 %
15-35	5.5 %	4.3 %	5.2 %	5.0 %
36-60	-	5.7 %	5.1 %	5.4 %
61-90	5.0 %	5.8 %	5.0 %	5.1 %
91-180	-	6.0 %	5.0 %	5.1 %
>180	5.2 %	5.3 %	4.9 %	5.2 %
Total	5.4 %	4.9 %	4.9 %	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	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	107	3349	2422	6	91	2405	2661	22	94	2039	1854
Intragruppo y off-shore***	0	0	1116	862	0	0	1658	816	0	0	938	460
Otros	107	10	653	1834	91	6	447	1032	94	22	695	1357
Total	117	117	5118	5118	97	97	4510	4510	116	116	3671	3671

* 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.