

Fecha de Publicación: 7 de enero de 2016

Fecha de Información: 05 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\$712.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	137.0	142.7	58.0	59.5	18.9	11.8	65.8
15-35	208.0	245.5	125.8	75.9	9.0	21.4	110.8
36-60	3.6	5.5	0.0	0.0	5.5	3.6	0.0
61-90	3.1	12.7	0.0	0.0	12.7	3.1	0.0
91-180	33.4	13.3	0.0	30.0	11.8	1.9	1.5
>180	55.0	45.2	30.0	0.0	0.2	40.0	15.0
Total	440.2	464.9	213.8	165.4	58.1	81.8	193.0

* 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	
3-14	3.7 %	4.0 %	1.8 %	3.6 %
15-35	3.4 %	3.1 %	3.5 %	3.3 %
36-60	-	4.3 %	3.3 %	3.9 %
61-90	-	5.7 %	3.0 %	5.2 %
91-180	4.7 %	4.9 %	4.3 %	4.5 %
>180	5.0 %	5.1 %	4.7 %	4.9 %
Total	3.6 %	3.9 %	3.7 %	3.8 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de enero				11 al 15 de enero				18 al 22 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	95	1891	2080	27	122	2281	2575	10	136	1833	2017
Intragrupo y off-shore***	0	0	1278	910	0	0	1298	626	0	0	1084	283
Otros	95	19	272	450	122	27	692	1071	136	10	479	1097
Total	114	114	3441	3441	149	149	4272	4272	146	146	3397	3397

* 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.