

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2016

Fecha de Información: 14 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\$1958.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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	364.2	311.3	181.0	236.5	44.3	41.7	86.0
15-35	488.3	429.4	310.5	210.0	43.9	203.3	75.0
36-60	28.2	70.8	11.0	0.0	32.8	1.2	27.0
61-90	42.6	8.9	0.0	0.0	8.9	42.6	0.0
91-180	107.4	151.9	85.0	0.0	66.9	107.4	0.0
>180	62.3	121.4	42.0	22.1	39.4	0.2	40.0
Total	1092.9	1093.7	629.5	468.6	236.2	396.3	228.0

* 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	5.3 %	4.4 %	3.5 %	4.1 %
15-35	4.3 %	4.0 %	4.2 %	4.1 %
36-60	4.1 %	4.4 %	2.8 %	4.3 %
61-90	-	5.3 %	4.2 %	4.4 %
91-180	-	5.0 %	4.6 %	4.8 %
>180	5.1 %	5.3 %	5.2 %	5.2 %
Total	4.8 %	4.5 %	4.0 %	4.3 %

*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	11 al 15 de enero				18 al 22 de enero				25 al 29 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	130	3062	3100	10	134	2580	2541	11	123	2169	1621
Intragrupo y off-shore***	0	0	1453	1038	0	0	1333	634	0	0	704	407
Otros	130	55	748	1124	134	10	460	1197	123	11	554	1399
Total	185	185	5262	5262	144	144	4372	4372	134	134	3426	3426

* 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.