

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1274.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	225.9	114.2	74.5	136.8	6.7	56.2	33.0
15-35	499.5	335.2	222.0	307.0	56.7	136.0	56.5
36-60	4.8	22.2	0.0	0.0	21.8	4.4	0.4
61-90	11.5	6.5	0.0	0.0	6.5	11.5	0.0
91-180	72.9	25.4	0.0	0.0	25.4	72.9	0.0
>180	19.1	27.2	20.0	0.0	7.2	19.1	0.0
Total	833.6	530.7	316.5	443.8	124.3	299.9	89.9

* 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	5.1 %	5.7 %	2.1 %	3.3 %
15-35	0.9 %	5.3 %	5.2 %	4.9 %
36-60	5.1 %	5.7 %	4.8 %	5.5 %
61-90	-	5.7 %	5.1 %	5.3 %
91-180	-	5.6 %	5.0 %	5.1 %
>180	-	5.4 %	5.1 %	5.2 %
Total	2.4 %	5.4 %	4.3 %	4.5 %

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {360 / \text{Plazo}}) - 1$. 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	3253	2401	5	93	2216	2549	21	92	2013	1800
Intragruppo y off-shore***	0	0	1114	797	0	0	1588	791	0	0	906	455
Otros	128	10	653	1823	93	5	435	898	92	21	682	1347
Total	138	138	5021	5021	98	98	4238	4238	113	113	3601	3601

* 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.