

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2016

Fecha de Información: 29 de diciembre 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\$679.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	151.9	83.4	6.5	58.0	9.9	26.9	67.0
15-35	255.6	318.3	147.0	23.0	31.1	92.4	140.3
36-60	17.5	16.6	0.0	0.0	16.6	17.5	0.0
61-90	11.1	7.1	0.0	10.0	7.1	1.1	0.0
91-180	0.1	14.5	0.0	0.0	14.5	0.1	0.0
>180	0.0	10.6	0.0	0.0	10.6	0.0	0.0
Total	436.3	450.5	153.5	91.0	89.7	138.0	207.3

* 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	3.0 %	4.8 %	2.7 %	3.0 %
15-35	3.2 %	3.2 %	2.4 %	2.9 %
36-60	-	4.4 %	4.1 %	4.2 %
61-90	-	4.8 %	4.0 %	4.3 %
91-180	-	5.1 %	4.3 %	5.1 %
>180	-	5.6 %	-	5.6 %
Total	3.1 %	3.8 %	2.7 %	3.2 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	28 de dic. al 1 de enero				4 al 8 de enero				11 al 15 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	137	1287	1355	10	92	1699	1912	20	117	2141	2378
Intragruppo y off-shore***	0	0	720	724	0	0	1189	795	0	0	1242	620
Otros	137	44	312	241	92	10	257	438	117	20	648	1034
Total	181	181	2320	2320	102	102	3145	3145	137	137	4031	4031

* 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.