

Fecha de Publicación: 5 de enero de 2016

Fecha de Información: 30 de diciembre 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\$786.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	77.1	70.2	0.0	6.5	20.2	20.6	50.0
15-35	318.3	381.0	187.5	74.9	65.2	115.2	128.3
36-60	4.4	24.1	0.0	0.0	24.1	4.4	0.0
61-90	27.4	34.4	0.0	10.0	24.1	7.1	10.3
91-180	0.9	26.5	10.0	0.0	16.5	0.9	0.0
>180	1.7	9.0	0.0	0.0	9.0	1.7	0.0
Total	429.8	545.2	197.5	91.4	159.2	149.9	188.6

* 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	5.0 %	5.5 %	3.3 %	4.6 %
15-35	4.2 %	3.4 %	2.8 %	3.4 %
36-60	-	4.9 %	3.6 %	4.7 %
61-90	4.4 %	4.9 %	4.6 %	4.7 %
91-180	-	5.1 %	4.3 %	5.1 %
>180	-	5.5 %	4.9 %	5.4 %
Total	4.4 %	4.1 %	3.1 %	3.9 %

*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	98	1722	1933	20	119	2234	2460
Intragruppo y off-shore***	0	0	720	724	0	0	1189	795	0	0	1247	626
Otros	137	44	312	241	98	10	263	447	119	20	669	1065
Total	180	180	2320	2320	108	108	3175	3175	138	138	4150	4150

* 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.