Fecha de Publicación: 14 de enero de 2016

Fecha de Información: 12 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$1038.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.[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	227.0	155.6	95.7	165.8	41.0	42.2	19.0
15-35	208.5	311.9	216.4	92.5	65.5	86.0	30.0
36-60	1.8	30.2	0.0	0.0	30.2	1.8	0.0
61-90	2.4	17.6	0.0	0.0	17.6	2.4	0.0
91-180	11.3	23.2	0.0	11.3	23.2	0.1	0.0
>180	0.0	97.7	0.0	0.0	97.7	0.0	0.0
Total	**450.9**	**636.3**	**312.1**	**269.5**	**275.2**	**132.4**	**49.0**

* 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	3.9 %	3.7 %	2.9 %	3.3 %
15-35	3.9 %	4.1 %	3.5 %	3.9 %
36-60	-	4.4 %	3.2 %	4.3 %
61-90	-	4.5 %	4.1 %	4.4 %
91-180	-	4.9 %	4.7 %	4.9 %
>180	-	5.8 %	-	5.8 %
Total	3.9 %	4.4 %	3.3 %	4.0 %

*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	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**	54	135	2925	3044	10	139	2078	2082	12	117	1946	1470
Intragrupo y off-shore***	0	0	1400	916	0	0	1164	424	0	0	662	368
Otros	135	54	756	1121	139	10	424	1160	117	12	512	1281
Total	**190**	**190**	**5081**	**5081**	**149**	**149**	**3666**	**3666**	**128**	**128**	**3120**	**3120**

* 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.