

Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 30 de noviembre de lunes 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\$1224.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	393.1	109.1	43.3	213.5	13.6	127.4	52.3
15-35	220.6	255.9	120.9	117.8	70.3	38.1	64.8
36-60	52.8	132.1	35.0	0.0	67.1	22.8	30.0
61-90	28.0	10.9	0.0	0.0	10.9	28.0	0.0
91-180	2.9	47.1	0.0	0.0	47.1	2.9	0.0
>180	64.4	54.6	0.1	0.0	54.6	64.4	0.0
Total	761.7	609.7	199.2	331.2	263.5	283.5	147.0

* 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	1.1 %	3.1 %	0.8 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	0.3 %	2.3 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	3.4 %	2.6 %	2.9 %
91-180	-	4.5 %	3.5 %	4.5 %
>180	-	5.2 %	4.2 %	4.7 %
Total	1.1 %	2.8 %	1.6 %	2.0 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	95	91	4083	3374	20	188	2131	2063	32	179	3395	3523
Intragruppo y off-shore***	0	73	1770	1865	0	0	1163	720	0	0	2086	931
Otros	91	22	789	1404	188	20	498	1008	179	32	652	1679
Total	186	186	6643	6643	207	207	3792	3792	212	212	6133	6133

* 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.