

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 02 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\$1098.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	196.3	154.7	64.4	93.5	36.3	48.8	54.0
15-35	241.4	228.1	183.0	199.8	18.1	14.6	27.0
36-60	51.4	47.1	25.5	2.0	21.6	49.4	0.0
61-90	119.6	94.5	35.0	0.0	39.5	99.6	20.0
91-180	21.5	22.8	10.0	3.5	2.8	8.0	10.0
>180	15.2	16.9	12.5	1.0	4.3	14.2	0.0
Total	645.4	564.1	330.5	299.8	122.6	234.6	111.0

* 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	-0.7 %	1.0 %	0.5 %	0.4 %
15-35	1.0 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
36-60	-	1.7 %	1.1 %	1.4 %
61-90	1.9 %	2.7 %	2.1 %	2.2 %
91-180	3.0 %	3.4 %	2.7 %	3.0 %
>180	-	4.4 %	4.2 %	4.3 %
Total	0.5 %	1.6 %	1.2 %	1.3 %

*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	97	4361	3646	24	195	2318	2195	31	181	3518	3581
Intragruppo y off-shore***	0	73	1914	1993	0	0	1187	762	0	0	2092	1012
Otros	97	22	821	1457	195	24	512	1059	181	31	679	1696
Total	192	192	7095	7095	218	218	4017	4017	212	212	6289	6289

* 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.