

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 09 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\$1359.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.4%.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	351.1	199.6	78.9	243.4	25.2	12.1	95.5
15-35	246.4	267.4	224.5	171.6	15.4	47.4	27.5
36-60	115.8	61.9	0.0	0.0	61.9	115.8	0.0
61-90	10.0	54.5	33.6	0.0	20.9	10.0	0.0
91-180	30.4	43.4	30.0	0.0	13.4	30.4	0.0
>180	46.9	54.6	11.2	0.3	43.4	46.6	0.0
Total	800.6	681.5	378.2	415.3	180.3	262.3	123.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.1 %	1.3 %	-4.5 %	-2.2 %
15-35	0.4 %	1.1 %	0.5 %	0.8 %
36-60	-	1.8 %	0.9 %	1.2 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	2.1 %
91-180	-	3.3 %	2.5 %	3.0 %
>180	-	4.3 %	3.4 %	3.8 %
Total	0.2 %	2.0 %	-0.6 %	0.4 %

*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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre				21 al 25 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	188	2999	2501	35	200	3910	3941	19	106	1138	1665
Intragruppo y off-shore***	0	0	1323	1236	0	0	2293	1233	0	0	1008	531
Otros	188	31	536	1120	200	35	693	1723	106	19	180	131
Total	218	218	4858	4858	235	235	6897	6897	126	126	2326	2326

* 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.