

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 11 de diciembre de viernes 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\$817.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	204.4	142.1	41.0	76.6	5.6	32.2	95.5
15-35	178.2	275.3	183.6	79.0	21.2	28.7	70.5
36-60	14.6	9.1	0.0	0.0	9.1	14.6	0.0
61-90	36.2	24.7	10.0	0.0	14.7	36.2	0.0
91-180	48.1	45.4	28.0	10.0	2.4	23.1	15.0
>180	14.3	6.0	5.1	10.0	0.9	4.3	0.0
Total	495.7	502.7	267.7	175.6	54.0	139.1	181.0

* 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	-0.5 %	0.2 %	-1.2 %	-0.6 %
15-35	0.4 %	0.4 %	0.4 %	0.4 %
36-60	-	1.6 %	0.9 %	1.2 %
61-90	-	1.9 %	1.7 %	1.8 %
91-180	3.0 %	3.2 %	2.9 %	3.0 %
>180	-	4.7 %	4.2 %	4.3 %
Total	0.1 %	0.9 %	0.7 %	0.6 %

*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	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	193	3042	2502	69	202	4288	4103	39	108	1190	1722
Intragruppo y off-shore***	0	0	1323	1278	0	0	2364	1509	0	0	1020	541
Otros	193	31	537	1121	202	69	708	1749	108	39	186	133
Total	224	224	4901	4901	271	271	7360	7360	147	147	2396	2396

* 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.