

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 14 de diciembre 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\$1070.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.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	342.5	272.1	122.0	184.4	31.1	39.2	119.0
15-35	211.3	204.7	92.4	100.4	32.8	31.5	79.5
36-60	62.5	28.7	0.0	0.0	28.7	62.5	0.0
61-90	11.8	15.6	0.0	0.0	15.6	11.8	0.0
91-180	80.3	35.6	17.1	10.0	8.5	60.3	10.0
>180	2.2	11.4	10.0	0.0	1.4	2.2	0.0
Total	710.5	568.0	241.5	294.7	118.0	207.3	208.5

* 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	0.4 %	3.0 %	-2.1 %	0.1 %
15-35	2.2 %	0.4 %	0.0 %	0.7 %
36-60	-	1.8 %	0.6 %	1.0 %
61-90	-	2.7 %	1.0 %	2.0 %
91-180	2.7 %	3.1 %	2.5 %	2.6 %
>180	-	4.7 %	4.2 %	4.4 %
Total	1.2 %	1.9 %	-0.4 %	0.7 %

*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	14 al 18 de diciembre				21 al 25 de diciembre				28 de dic. al 1 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	68	218	4495	4289	52	108	1280	1784	8	146	1010	1159
Intragruppo y off-shore***	0	0	2467	1634	0	0	1039	585	0	0	663	565
Otros	218	68	722	1761	108	52	188	138	146	8	245	194
Total	286	286	7684	7684	159	159	2508	2508	153	153	1918	1918

* 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.