

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 15 de diciembre de martes 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\$938.9 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	260.6	176.8	95.0	180.0	20.5	19.3	61.2
15-35	223.5	283.2	163.5	89.4	27.5	41.9	92.2
36-60	7.0	53.3	14.0	0.0	39.3	7.0	0.0
61-90	19.6	4.6	0.0	12.9	4.6	6.7	0.0
91-180	47.7	14.1	0.0	10.0	14.1	37.7	0.0
>180	0.1	2.0	0.0	0.0	2.0	0.1	0.0
Total	558.5	533.8	272.5	292.3	107.9	112.8	153.5

* 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	0.1 %	0.7 %	-0.2 %	0.1 %
15-35	0.0 %	0.3 %	-0.4 %	0.0 %
36-60	-	1.5 %	0.4 %	1.4 %
61-90	-	3.3 %	1.8 %	2.4 %
91-180	-	4.0 %	2.8 %	3.2 %
>180	-	5.2 %	3.8 %	5.1 %
Total	0.1 %	0.9 %	0.2 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	63	234	4666	4356	67	115	1346	1864	8	148	1021	1161
Intragruppo y off-shore***	0	0	2508	1760	0	0	1093	628	0	0	663	576
Otros	234	63	709	1766	115	67	192	140	148	8	247	194
Total	297	297	7883	7883	181	181	2631	2631	156	156	1931	1931

* 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.