

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 16 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\$1053.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	215.7	89.0	45.1	173.2	17.9	16.5	26.0
15-35	205.8	292.9	231.5	103.9	21.9	62.4	39.5
36-60	40.7	42.0	0.0	0.0	42.0	40.7	0.0
61-90	41.6	30.1	0.0	0.0	20.1	31.6	10.0
91-180	24.7	138.8	42.3	0.0	76.5	4.7	20.0
>180	10.8	17.3	0.0	0.0	17.3	10.8	0.0
Total	539.3	610.1	318.9	277.1	195.7	166.7	95.5

* 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	-0.7 %	0.3 %	-2.1 %	-1.3 %
15-35	-1.3 %	-0.4 %	-0.8 %	-0.6 %
36-60	-	-1.3 %	-2.8 %	-2.0 %
61-90	1.4 %	2.7 %	1.0 %	1.6 %
91-180	2.4 %	3.7 %	1.8 %	3.4 %
>180	-	4.8 %	4.1 %	4.5 %
Total	-0.1 %	0.9 %	-1.2 %	-0.1 %

* 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	228	4743	4373	77	117	1394	1901	8	148	1101	1198
Intragrupo y off-shore***	0	0	2517	1837	0	0	1129	670	0	0	663	630
Otros	228	63	716	1766	117	77	194	145	148	8	258	194
Total	292	292	7977	7977	194	194	2716	2716	156	156	2022	2022

* 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.