

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 17 de diciembre de jueves 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\$1754.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.1%.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	189.8	94.1	62.0	152.0	12.1	17.8	20.0
15-35	684.8	699.7	466.8	131.0	26.6	347.6	206.3
36-60	6.0	31.2	6.0	0.0	25.2	6.0	0.0
61-90	91.5	33.7	5.0	0.0	28.7	91.5	0.0
91-180	72.8	58.0	37.1	5.0	20.9	67.8	0.0
>180	5.2	13.8	0.0	0.0	13.8	5.2	0.0
Total	1050.1	930.5	576.9	288.0	127.4	535.8	226.3

* 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	0.0 %	0.2 %	-1.1 %	-0.6 %
15-35	0.0 %	-0.1 %	-0.4 %	-0.2 %
36-60	-	0.7 %	0.0 %	0.6 %
61-90	-	2.4 %	0.9 %	1.3 %
91-180	-	2.9 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	4.8 %	3.9 %	4.5 %
Total	0.0 %	0.5 %	-0.1 %	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	227	4855	4406	104	122	1440	1926	8	148	1105	1231
Intragruppo y off-shore***	0	0	2528	1926	0	0	1154	733	0	0	689	630
Otros	226	63	718	1769	122	104	194	129	148	8	266	198
Total	290	290	8102	8102	227	227	2788	2788	156	156	2059	2059

* 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.