

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 18 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\$797.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	71.3	46.1	25.5	55.5	20.6	15.8	0.0
15-35	180.6	395.0	259.5	21.5	21.5	45.1	114.0
36-60	3.6	45.5	0.0	0.0	45.5	3.6	0.0
61-90	57.1	36.6	17.0	20.0	4.6	22.1	15.0
91-180	37.5	9.3	0.0	0.0	9.3	37.5	0.0
>180	40.2	23.8	0.0	20.0	3.8	0.2	20.0
Total	390.4	556.3	302.0	117.0	105.3	124.4	149.0

* 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	-	0.3 %	-1.4 %	-0.7 %
15-35	0.0 %	0.3 %	-0.3 %	0.1 %
36-60	-	0.8 %	-1.3 %	0.7 %
61-90	2.9 %	2.7 %	1.0 %	2.0 %
91-180	-	4.0 %	1.5 %	2.0 %
>180	4.4 %	4.8 %	4.1 %	4.3 %
Total	0.9 %	0.7 %	0.3 %	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	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	225	4855	4401	107	126	1495	1951	13	149	1122	1253
Intragruppo y off-shore***	0	0	2528	1926	0	0	1179	778	0	0	689	640
Otros	225	63	714	1769	126	107	193	138	149	13	287	205
Total	288	288	8097	8097	233	233	2867	2867	162	162	2097	2097

* 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.