

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 21 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\$492.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	93.9	33.6	19.3	74.0	10.1	15.7	4.3
15-35	66.9	205.8	174.4	8.4	28.4	55.5	3.0
36-60	24.5	21.3	0.0	0.0	21.3	24.5	0.0
61-90	29.4	5.9	0.0	0.0	5.9	29.4	0.0
91-180	5.1	4.7	0.3	0.3	4.4	4.8	0.0
>180	6.9	1.5	0.0	0.0	1.5	6.9	0.0
Total	226.7	272.8	193.9	82.7	71.6	136.8	7.3

* 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 %	0.9 %	0.1 %	0.3 %
15-35	2.1 %	1.2 %	0.1 %	0.9 %
36-60	-	1.7 %	1.1 %	1.4 %
61-90	-	3.2 %	2.7 %	2.7 %
91-180	-	3.9 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	4.8 %	2.1 %	2.6 %
Total	0.9 %	1.3 %	0.8 %	1.1 %

*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	21 al 25 de diciembre				28 de dic. al 1 de enero				4 al 8 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	78	132	1534	1975	41	144	1178	1265	9	87	1582	1817
Intragruppo y off-shore***	0	0	1198	808	0	0	689	684	0	0	1160	769
Otros	132	78	194	143	144	41	299	216	87	9	238	394
Total	210	210	2926	2926	185	185	2165	2165	96	96	2980	2980

* 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.