

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 22 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\$437.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	52.1	37.4	19.9	35.9	7.6	6.2	10.0
15-35	102.7	177.7	111.6	33.0	18.1	21.7	48.0
36-60	11.0	7.7	0.0	0.0	7.7	11.0	0.0
61-90	5.1	10.8	7.0	0.0	3.8	5.1	0.0
91-180	29.0	40.2	0.0	11.0	40.2	18.0	0.0
>180	9.9	16.4	4.5	0.0	6.9	4.9	5.0
Total	209.8	290.4	143.0	79.9	84.4	66.9	63.0

* 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	3.2 %	4.1 %	2.1 %	3.0 %
15-35	2.7 %	2.4 %	1.5 %	2.3 %
36-60	-	3.2 %	1.2 %	2.1 %
61-90	-	3.2 %	1.8 %	2.7 %
91-180	-	3.9 %	3.0 %	3.6 %
>180	4.7 %	4.8 %	4.1 %	4.6 %
Total	2.9 %	3.2 %	2.0 %	2.7 %

*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**	82	130	1565	1982	41	151	1200	1279	9	89	1596	1846
Intragruppo y off-shore***	0	0	1204	827	0	0	692	693	0	0	1184	777
Otros	130	82	194	155	151	41	300	220	89	9	238	396
Total	211	211	2964	2964	192	192	2192	2192	99	99	3019	3019

* 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.