

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 23 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\$669.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	17.0	13.8	6.0	0.0	7.8	17.0	0.0
15-35	217.4	268.4	174.0	127.0	61.9	57.9	32.5
36-60	0.9	10.7	0.0	0.0	10.7	0.9	0.0
61-90	64.1	113.0	70.0	30.0	8.9	0.0	34.1
91-180	6.7	15.5	0.0	0.0	15.5	6.7	0.0
>180	2.3	6.3	0.0	0.0	6.3	2.3	0.0
Total	308.4	427.7	250.0	157.0	111.2	84.8	66.6

* 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	-	9.9 %	-0.2 %	4.4 %
15-35	3.4 %	4.3 %	4.0 %	4.1 %
36-60	-	3.7 %	2.0 %	3.6 %
61-90	3.8 %	4.0 %	2.1 %	3.6 %
91-180	-	5.0 %	4.1 %	4.7 %
>180	-	5.3 %	4.0 %	4.9 %
Total	3.6 %	4.5 %	3.4 %	4.0 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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	128	1568	1984	41	132	1206	1299	10	91	1605	1857
Intragruppo y off-shore***	0	0	1204	827	0	0	698	693	0	0	1184	777
Otros	128	82	196	158	132	41	314	226	91	10	249	404
Total	209	209	2968	2968	173	173	2219	2219	100	100	3038	3038

* 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.