

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 24 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\$224.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.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	12.4	18.0	8.4	8.0	9.6	4.4	0.0
15-35	68.3	93.7	79.7	11.9	14.0	56.4	0.0
36-60	3.3	7.8	0.4	0.0	7.4	3.3	0.0
61-90	0.0	4.5	0.1	0.0	4.4	0.0	0.0
91-180	0.3	12.9	0.0	0.0	12.9	0.3	0.0
>180	0.3	2.8	0.0	0.0	2.8	0.3	0.0
Total	84.5	139.7	88.6	19.9	51.1	64.6	0.0

* 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	-	4.9 %	1.2 %	3.7 %
15-35	-	4.4 %	3.6 %	3.9 %
36-60	-	4.3 %	3.3 %	4.0 %
61-90	-	5.2 %	-	5.2 %
91-180	-	5.4 %	4.4 %	5.4 %
>180	-	5.5 %	4.4 %	5.4 %
Total	-	4.6 %	3.4 %	4.1 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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	44	130	1185	1309	10	90	1637	1865
Intragruppo y off-shore***	0	0	1204	827	0	0	706	693	0	0	1184	785
Otros	128	82	196	158	130	44	316	205	90	10	257	428
Total	209	209	2969	2969	174	174	2208	2208	99	99	3078	3078

* 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.