

Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 28 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\$330.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	34.9	31.5	12.0	18.5	8.6	5.4	11.0
15-35	156.9	104.8	30.5	53.0	37.3	66.9	37.0
36-60	3.9	11.5	0.0	0.0	11.5	3.9	0.0
61-90	2.5	5.8	0.0	0.0	5.8	2.5	0.0
91-180	2.3	7.0	0.0	0.0	7.0	2.3	0.0
>180	0.6	16.4	0.0	0.0	16.4	0.6	0.0
Total	201.1	177.0	42.5	71.5	86.6	81.6	48.0

* 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	2.8 %	5.0 %	2.3 %	3.4 %
15-35	3.0 %	3.3 %	3.2 %	3.2 %
36-60	-	5.9 %	2.8 %	5.1 %
61-90	-	4.9 %	2.7 %	4.2 %
91-180	-	5.3 %	4.3 %	5.1 %
>180	-	5.5 %	4.7 %	5.4 %
Total	3.0 %	4.3 %	3.1 %	3.5 %

*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	28 de dic. al 1 de enero				4 al 8 de enero				11 al 15 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	134	1211	1329	10	93	1645	1871	20	116	2101	2379
Intragruppo y off-shore***	0	0	718	712	0	0	1184	785	0	0	1242	583
Otros	134	44	313	201	93	10	263	436	116	20	649	1030
Total	178	178	2242	2242	103	103	3092	3092	136	136	3992	3992

* 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.