

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 07 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\$821.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	178.8	185.4	90.2	75.3	17.0	25.3	78.3
15-35	137.9	234.1	175.6	75.7	16.5	20.2	42.0
36-60	63.9	11.7	3.0	0.0	3.7	58.9	5.0
61-90	23.7	15.9	0.0	1.5	15.9	22.2	0.0
91-180	30.0	20.8	0.0	0.0	10.8	20.0	10.0
>180	40.6	14.1	13.0	1.3	1.1	39.3	0.0
Total	474.9	482.0	281.8	153.7	65.0	186.0	135.3

* 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	0.3 %	0.4 %	-0.5 %	0.1 %
15-35	1.0 %	1.2 %	0.3 %	0.9 %
36-60	0.6 %	2.5 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	2.6 %	1.6 %	2.0 %
91-180	2.9 %	4.4 %	2.5 %	3.1 %
>180	-	3.1 %	3.6 %	3.5 %
Total	0.7 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %

*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre				21 al 25 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	195	2807	2445	34	205	3761	3822	19	106	1126	1639
Intragruppo y off-shore***	0	0	1309	1090	0	0	2228	1136	0	0	1008	531
Otros	195	31	534	1115	205	34	684	1715	106	19	164	129
Total	226	226	4650	4650	239	239	6673	6673	125	125	2298	2298

* 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.