

Fecha de Publicación: 9 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 04 de diciembre de viernes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1334.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	318.8	220.2	116.2	192.0	23.0	45.8	81.0
15-35	220.7	341.2	274.3	142.5	6.9	18.2	60.0
36-60	60.1	20.8	3.0	0.0	17.8	60.1	0.0
61-90	86.4	73.7	50.5	0.0	23.2	86.4	0.0
91-180	44.6	47.5	16.0	0.0	31.5	44.6	0.0
>180	28.9	17.8	10.0	5.0	2.8	18.9	5.0
Total	759.5	721.2	469.9	339.5	105.3	274.0	146.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	0.3 %	0.7 %	0.1 %	0.4 %
15-35	0.3 %	0.5 %	0.3 %	0.4 %
36-60	-	1.1 %	1.0 %	1.0 %
61-90	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	3.3 %	3.3 %	3.3 %
>180	4.6 %	4.1 %	4.0 %	4.1 %
Total	0.4 %	1.1 %	1.0 %	0.9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards**

Sectores	30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	99	94	4415	3674	32	203	2737	2393	31	206	3650	3698
Intragruo y off-shore***	0	73	1928	2036	0	0	1279	1054	0	0	2174	1096
Otros	94	26	821	1454	203	32	526	1095	206	31	678	1708
Total	193	193	7164	7164	235	235	4542	4542	237	237	6502	6502

* 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.

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 intragruo.