

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 17 de noviembre de martes 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\$1470.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	402.9	108.1	18.7	246.5	14.4	81.5	75.0
15-35	506.5	322.9	229.0	148.3	62.9	327.2	31.0
36-60	38.3	71.6	45.0	0.0	11.6	23.3	15.0
61-90	4.0	18.0	0.0	0.0	18.0	4.0	0.0
91-180	2.5	23.1	9.6	0.0	13.5	2.5	0.0
>180	85.7	7.5	0.1	3.4	7.4	82.3	0.0
Total	1039.9	551.2	302.5	398.1	127.7	520.8	121.0

* 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	2.6 %	3.4 %	1.8 %	2.1 %
15-35	2.3 %	3.7 %	3.3 %	3.4 %
36-60	3.4 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
61-90	-	4.8 %	3.2 %	4.5 %
91-180	-	4.8 %	3.5 %	4.6 %
>180	-	5.3 %	4.5 %	4.6 %
Total	2.6 %	3.8 %	2.9 %	3.1 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	131	4446	3723	22	145	2941	2880	12	81	3087	2638
Intragruppo y off-shore***	0	0	1982	1564	0	0	1462	710	0	0	1339	1356
Otros	131	26	551	1693	145	22	645	1458	81	12	727	1159
Total	157	157	6980	6980	167	167	5049	5049	93	93	5153	5153

* 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.