

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 19 de noviembre 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\$1872.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	427.8	259.6	136.2	305.6	41.9	40.7	81.5
15-35	382.4	506.2	359.5	148.0	7.2	94.9	139.5
36-60	2.2	36.3	0.0	0.0	36.3	2.2	0.0
61-90	202.9	25.7	10.0	0.0	5.7	192.9	10.0
91-180	65.6	67.6	45.7	13.3	11.9	42.3	10.0
>180	98.7	55.0	0.0	5.0	38.0	76.7	17.0
Total	1179.7	950.4	551.4	471.9	141.0	449.7	258.0

* 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	-7.7 %	1.9 %	0.6 %	-0.6 %
15-35	1.5 %	1.9 %	0.8 %	1.4 %
36-60	-	3.1 %	1.5 %	3.0 %
61-90	3.2 %	2.6 %	2.9 %	2.9 %
91-180	3.0 %	3.8 %	3.2 %	3.5 %
>180	4.6 %	4.8 %	3.7 %	4.1 %
Total	-1.1 %	2.4 %	1.6 %	1.4 %

*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	143	4770	3757	23	154	3273	3106	13	82	3198	2765
Intragruppo y off-shore***	0	0	1982	1841	0	0	1583	929	0	0	1422	1416
Otros	143	26	545	1700	154	23	670	1491	82	13	750	1188
Total	169	169	7298	7298	177	177	5526	5526	95	95	5370	5370

* 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.