

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 24 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\$1834.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	423.1	190.8	68.0	253.3	29.5	76.6	93.3
15-35	287.0	332.2	204.3	133.0	54.9	81.0	73.0
36-60	52.0	23.4	0.0	0.0	18.4	47.0	5.0
61-90	296.8	179.9	76.0	0.0	66.9	259.8	37.0
91-180	15.1	136.3	64.6	0.0	56.7	0.1	15.0
>180	106.3	34.3	0.0	35.0	14.3	51.3	20.0
Total	1180.4	896.9	412.8	421.3	240.8	515.8	243.3

* 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	0.5 %	1.4 %	0.7 %	0.8 %
15-35	1.3 %	1.5 %	1.2 %	1.4 %
36-60	1.8 %	2.3 %	1.6 %	1.8 %
61-90	1.5 %	2.6 %	2.0 %	2.2 %
91-180	3.6 %	3.8 %	3.7 %	3.8 %
>180	4.3 %	5.0 %	4.2 %	4.3 %
Total	1.4 %	2.3 %	1.5 %	1.8 %

*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	23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	174	3662	3297	16	83	3676	3139	15	188	1787	1876
Intragruppo y off-shore***	0	0	1655	1209	0	0	1635	1675	0	0	1094	552
Otros	174	24	700	1510	83	16	790	1288	188	15	464	917
Total	198	198	6017	6017	98	98	6102	6102	203	203	3346	3346

* 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.