

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 26 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\$259.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	27.2	39.3	30.0	10.0	4.3	12.2	5.0
15-35	96.9	117.3	46.0	30.0	10.3	5.9	61.0
36-60	5.2	15.5	7.3	0.0	8.2	5.2	0.0
61-90	0.6	1.9	0.0	0.0	1.9	0.6	0.0
91-180	1.3	1.6	0.0	0.0	1.6	1.3	0.0
>180	16.8	1.4	0.0	0.0	1.4	16.8	0.0
Total	148.0	177.0	83.3	40.0	27.7	42.0	66.0

* 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	1.5 %	1.7 %	0.1 %	1.1 %
15-35	0.6 %	0.6 %	1.3 %	0.8 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.8 %
61-90	-	3.9 %	3.2 %	3.7 %
91-180	-	4.6 %	3.7 %	4.2 %
>180	-	4.9 %	4.4 %	4.4 %
Total	0.6 %	1.3 %	1.7 %	1.2 %

*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	178	3742	3366	20	90	3791	3235	19	188	1918	1964
Intragrupoy off-shore***	0	0	1684	1253	0	0	1704	1714	0	0	1133	608
Otros	178	24	707	1514	90	20	785	1331	188	19	479	959
Total	202	202	6133	6133	110	110	6280	6280	207	207	3530	3530

* 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.