

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2015

Fecha de Información: 27 de noviembre de viernes 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\$1035.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	237.3	137.2	54.0	137.5	15.6	32.2	67.6
15-35	307.2	399.1	222.5	131.3	38.4	37.7	138.3
36-60	17.1	20.6	5.0	0.0	1.4	2.9	14.3
61-90	5.6	74.4	50.0	0.0	24.4	5.6	0.0
91-180	24.0	15.9	10.0	20.0	5.9	4.0	0.0
>180	7.3	9.6	0.0	0.0	9.6	7.3	0.0
Total	598.5	656.9	341.5	288.8	95.3	89.7	220.1

* 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	0.9 %	1.6 %	0.5 %	0.8 %
15-35	1.6 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.5 %	2.4 %	2.5 %
91-180	-	4.0 %	3.3 %	3.6 %
>180	-	5.2 %	4.4 %	4.9 %
Total	1.4 %	1.8 %	1.1 %	1.5 %

*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	165	3742	3366	22	92	3948	3310	19	188	1996	2020
Intragruppo y off-shore***	0	0	1684	1253	0	0	1732	1811	0	0	1159	648
Otros	165	24	707	1514	92	22	786	1345	188	19	488	975
Total	190	190	6134	6134	114	114	6466	6466	207	207	3644	3644

* 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.