Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 09 de noviembre de lunes [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$1491.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	413.9	226.4	102.6	267.4	19.0	41.7	104.8
15-35	359.3	502.5	269.4	110.0	43.1	59.3	190.0
36-60	9.3	103.1	0.0	0.0	103.1	9.3	0.0
61-90	46.1	12.9	0.0	0.0	12.9	46.1	0.0
91-180	55.8	31.6	0.4	48.2	25.2	1.6	6.0
>180	23.7	18.4	0.0	0.0	7.4	12.7	11.0
Total	**908.2**	**894.9**	**372.5**	**425.6**	**210.7**	**170.8**	**311.8**

* 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	0.4 %	1.4 %	1.1 %	0.9 %
15-35	0.6 %	1.3 %	0.5 %	0.8 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.9 %
61-90	-	3.0 %	2.1 %	2.3 %
91-180	3.2 %	4.0 %	3.6 %	3.7 %
>180	4.5 %	4.6 %	4.2 %	4.4 %
Total	0.7 %	1.7 %	1.3 %	1.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	147	3214	3122	18	164	3840	3757	15	146	2609	2633
Intragrupo y off-shore***	0	0	1789	1176	0	0	1892	1234	0	0	1390	659
Otros	147	27	629	1333	164	18	793	1534	146	15	587	1295
Total	**174**	**174**	**5631**	**5631**	**182**	**182**	**6525**	**6525**	**161**	**161**	**4587**	**4587**

* 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.

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.