Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 12 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$2032.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.[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	420.4	174.3	74.5	152.1	27.8	196.3	72.0
15-35	610.7	784.6	595.9	171.5	39.7	290.2	149.0
36-60	4.2	2.5	0.0	0.0	2.5	4.2	0.0
61-90	14.1	23.2	20.0	0.0	3.2	14.1	0.0
91-180	72.7	91.9	5.0	0.0	66.9	52.7	20.0
>180	15.4	59.9	45.0	0.0	14.9	15.4	0.0
Total	**1137.5**	**1136.4**	**740.4**	**323.6**	**154.9**	**572.9**	**241.0**

* 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	3.2 %	3.2 %	2.6 %	2.8 %
15-35	2.8 %	1.7 %	2.4 %	2.1 %
36-60	-	4.2 %	2.5 %	3.1 %
61-90	-	2.5 %	3.4 %	2.8 %
91-180	3.9 %	5.0 %	3.6 %	4.4 %
>180	-	4.8 %	4.2 %	4.7 %
Total	3.0 %	2.4 %	2.6 %	2.6 %

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

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	144	3517	3173	21	163	4100	3771	17	145	2771	2793
Intragrupo y off-shore***	0	0	1789	1383	0	0	1934	1312	0	0	1454	662
Otros	144	27	641	1390	163	21	678	1629	145	17	605	1375
Total	**171**	**171**	**5947**	**5947**	**184**	**184**	**6712**	**6712**	**162**	**162**	**4830**	**4830**

* 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.