

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 17 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\$1963.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	320.2	323.6	242.2	226.2	23.4	36.0	58.0
15-35	327.6	621.4	450.8	165.5	79.6	71.1	91.0
36-60	89.5	2.5	0.0	0.0	2.5	89.5	0.0
61-90	148.2	79.8	0.4	65.0	14.5	18.2	65.0
91-180	85.4	20.0	0.7	70.5	9.3	4.9	10.0
>180	71.7	114.7	53.0	11.9	44.7	42.8	17.0
Total	1042.7	1161.9	747.0	539.1	174.0	262.6	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	7.0 %	7.0 %	7.4 %	7.2 %
15-35	6.7 %	6.5 %	6.3 %	6.4 %
36-60	-	6.7 %	5.6 %	5.6 %
61-90	5.7 %	5.6 %	5.6 %	5.6 %
91-180	5.5 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
>180	5.4 %	5.4 %	5.3 %	5.4 %
Total	6.4 %	6.4 %	6.3 %	6.4 %

*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	14 al 18 de noviembre												21 al 25 de noviembre				28 de nov. al 2 de diciembre			
	Delivery				NDF				Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	45	101	2988	2957	57	125	2239	2968	21	122	2429	2735								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1547	1358	0	0	1620	618	0	0	1439	792								
Otros	101	45	741	962	125	57	624	896	122	21	631	973								
Total	147	147	5276	5276	182	182	4482	4482	143	143	4500	4500								

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.