

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 18 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\$1183.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.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	148.1	238.1	141.3	31.4	29.8	49.7	67.0
15-35	304.9	390.2	220.7	119.6	19.5	35.3	150.0
36-60	81.3	16.5	0.3	2.3	16.3	79.0	0.0
61-90	81.5	34.1	0.0	10.0	24.1	61.5	10.0
91-180	36.3	9.0	0.0	32.4	9.0	3.9	0.0
>180	4.9	65.4	55.0	0.0	10.4	4.9	0.0
Total	657.0	753.3	417.2	195.6	109.1	234.3	227.0

* 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	7.3 %	7.0 %	5.5 %	6.6 %
15-35	7.2 %	7.2 %	6.9 %	7.1 %
36-60	-	6.2 %	5.5 %	5.6 %
61-90	6.1 %	5.9 %	5.4 %	5.6 %
91-180	-	5.9 %	6.6 %	6.4 %
>180	-	5.5 %	5.3 %	5.5 %
Total	7.2 %	6.7 %	6.0 %	6.5 %

* 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

Sector	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
Sector Financiero**	45	97	2988	2957	60	126	2288	3042	21	123	2523	2900
Intragrupa y off-shore***	0	0	1547	1358	0	0	1670	649	0	0	1530	792
Otros	97	45	741	962	126	60	638	904	123	21	648	1009
Total	142	142	5276	5276	186	186	4596	4596	144	144	4701	4701

* 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.