

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 21 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\$1525.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	458.6	373.9	171.6	266.2	74.2	64.4	128.0
15-35	164.5	377.1	304.1	105.5	31.5	17.5	41.5
36-60	27.4	25.2	5.0	5.0	20.2	22.4	0.0
61-90	61.1	16.7	0.0	0.0	16.7	61.1	0.0
91-180	57.3	66.4	22.3	41.7	39.0	10.6	5.0
>180	35.3	36.5	0.0	0.0	36.5	35.3	0.0
Total	804.2	895.7	503.1	418.4	218.1	211.3	174.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8.0 %	7.0 %	7.0 %	7.3 %
15-35	7.1 %	7.1 %	7.0 %	7.1 %
36-60	-	6.5 %	6.2 %	6.3 %
61-90	-	6.4 %	5.5 %	5.7 %
91-180	6.0 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
>180	-	5.5 %	5.4 %	5.4 %
Total	7.8 %	6.8 %	6.6 %	6.8 %

*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	21 al 25 de noviembre				28 de nov. al 2 de diciembre				5 al 9 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	128	2676	3184	22	123	2613	3136	18	75	1853	1854
Intragruppo y off-shore***	0	0	1710	915	0	0	1665	792	0	0	856	897
Otros	128	41	644	931	123	22	686	1037	75	18	689	647
Total	168	168	5030	5030	145	145	4964	4964	93	93	3398	3398

* 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 intragruppo.