

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 22 de noviembre de martes 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\$1930.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	509.0	393.4	191.2	298.5	67.2	75.5	135.0
15-35	391.5	646.2	395.5	103.0	47.7	85.5	203.0
36-60	81.1	86.4	0.0	0.0	26.4	21.1	60.0
61-90	75.1	16.8	1.8	15.3	15.0	59.8	0.0
91-180	53.6	73.0	15.0	0.0	58.0	53.6	0.0
>180	0.1	1.9	0.3	0.0	1.6	0.1	0.0
Total	1110.4	1217.7	603.8	416.8	216.0	295.6	398.0

* 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	7.1 %	6.8 %	6.4 %	6.7 %
15-35	7.3 %	7.4 %	7.1 %	7.3 %
36-60	6.9 %	6.8 %	6.0 %	6.7 %
61-90	-	6.4 %	5.8 %	5.9 %
91-180	-	5.8 %	5.7 %	5.7 %
>180	-	8.0 %	5.2 %	7.9 %
Total	7.2 %	7.0 %	6.4 %	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	127	3031	3254	38	125	2725	3373	19	75	1923	2074
Intragrupa y off-shore***	0	0	1712	1196	0	0	1794	810	0	0	1021	907
Otros	127	41	643	935	125	38	749	1085	75	19	694	657
Total	167	167	5386	5386	162	162	5268	5268	94	94	3637	3637

* 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.