

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 23 de noviembre de miércoles 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\$1959.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	391.4	596.5	329.9	190.1	105.6	40.3	161.0
15-35	341.6	611.7	334.9	57.5	32.8	40.1	244.0
36-60	25.6	5.1	0.0	9.5	5.1	16.1	0.0
61-90	102.4	27.9	8.0	33.5	19.9	68.9	0.0
91-180	62.9	42.0	0.0	28.5	42.0	34.4	0.0
>180	66.0	91.8	53.5	20.0	38.3	46.0	0.0
Total	989.9	1375.0	726.2	339.1	243.8	245.8	405.0

* 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	8.0 %	7.5 %	6.9 %	7.4 %
15-35	7.9 %	7.9 %	7.5 %	7.8 %
36-60	-	7.1 %	6.2 %	6.3 %
61-90	-	6.6 %	6.0 %	6.2 %
91-180	-	6.0 %	5.4 %	5.7 %
>180	-	5.4 %	5.5 %	5.5 %
Total	7.9 %	7.3 %	6.5 %	7.2 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	40	120	3075	3298	39	128	2971	3780	19	76	2065	2260
Intragruppo y off-shore***	0	0	1712	1226	0	0	2024	927	0	0	1124	950
Otros	120	40	666	929	128	39	820	1108	76	19	699	678
Total	160	160	5453	5453	167	167	5815	5815	95	95	3888	3888

* 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.