

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 24 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\$145.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	32.5	40.9	10.0	4.0	10.9	8.5	20.0
15-35	68.8	32.7	0.0	25.0	12.7	23.8	20.0
36-60	0.4	0.9	0.0	0.0	0.9	0.4	0.0
61-90	1.0	1.0	0.0	0.0	1.0	1.0	0.0
91-180	0.4	2.5	0.0	0.0	2.5	0.4	0.0
>180	3.1	1.3	0.0	0.0	1.3	3.1	0.0
Total	106.2	79.2	10.0	29.0	29.2	37.2	40.0

* 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	6.6 %	7.2 %	6.2 %	6.7 %
15-35	7.4 %	7.8 %	7.5 %	7.5 %
36-60	-	7.6 %	6.6 %	7.3 %
61-90	-	6.5 %	4.6 %	5.5 %
91-180	-	6.6 %	5.4 %	6.4 %
>180	-	6.4 %	4.6 %	5.1 %
Total	7.0 %	7.3 %	7.1 %	7.1 %

*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	122	3074	3301	39	127	3002	3820	19	76	2066	2262
Intragruppo y off-shore***	0	0	1712	1226	0	0	2034	931	0	0	1124	950
Otros	122	40	670	929	127	39	830	1115	76	19	701	679
Total	162	162	5456	5456	166	166	5866	5866	95	95	3891	3891

* 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.