

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 04 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\$1639.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	427.9	45.1	10.2	363.0	24.9	54.9	10.0
15-35	481.1	595.9	428.0	170.8	24.4	166.8	143.5
36-60	8.8	38.2	8.5	0.0	29.7	8.8	0.0
61-90	4.5	5.4	0.0	0.0	5.4	4.5	0.0
91-180	92.5	19.8	0.0	0.0	9.8	82.5	10.0
>180	49.3	49.9	0.0	25.0	34.9	9.3	15.0
Total	1064.0	754.2	446.7	558.8	129.1	326.7	178.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.3 %	3.7 %	2.2 %	2.5 %
15-35	3.1 %	4.1 %	3.1 %	3.5 %
36-60	-	4.4 %	2.9 %	4.1 %
61-90	-	5.2 %	4.0 %	4.7 %
91-180	4.3 %	5.3 %	4.5 %	4.6 %
>180	5.0 %	5.3 %	4.9 %	5.1 %
Total	3.6 %	4.2 %	3.0 %	3.5 %

*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	2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	159	3638	3121	21	143	2570	2814	18	162	3693	3638
Intragruppo y off-shore***	0	0	1876	1589	0	0	1633	756	0	0	1831	1187
Otros	159	16	425	1229	143	21	601	1234	162	18	801	1501
Total	175	175	5938	5938	165	165	4804	4804	180	180	6326	6326

* 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.