

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 13 de noviembre de viernes 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\$856.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	128.5	100.4	42.0	59.5	41.4	52.0	17.0
15-35	358.7	240.2	143.3	157.8	70.0	173.9	27.0
36-60	4.7	2.6	0.0	0.0	2.6	4.7	0.0
61-90	7.9	10.4	0.0	0.0	10.4	7.9	0.0
91-180	7.3	13.7	0.0	0.0	13.7	7.3	0.0
>180	24.4	2.6	0.0	0.0	1.8	23.5	0.8
Total	531.4	369.9	185.3	217.3	139.8	269.4	44.8

* 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	2.8 %	4.4 %	3.8 %	4.0 %
15-35	3.4 %	4.2 %	3.5 %	3.8 %
36-60	-	4.3 %	1.0 %	2.2 %
61-90	-	4.6 %	3.6 %	4.2 %
91-180	-	4.9 %	3.4 %	4.4 %
>180	4.7 %	5.4 %	4.3 %	4.4 %
Total	3.2 %	4.3 %	3.6 %	3.8 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	144	3517	3189	21	147	4180	3694	17	145	2820	2841
Intragruppo y off-shore***	0	0	1789	1383	0	0	1972	1361	0	0	1457	672
Otros	144	27	657	1391	147	21	559	1656	145	17	636	1400
Total	171	171	5963	5963	168	168	6711	6711	162	162	4913	4913

* 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.