

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 18 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\$1170.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	322.5	102.8	38.4	251.3	15.9	22.7	48.5
15-35	302.7	357.3	265.8	140.8	33.5	103.9	58.0
36-60	23.9	54.3	40.0	0.0	14.3	23.9	0.0
61-90	5.5	7.8	0.0	0.0	7.8	5.5	0.0
91-180	32.3	38.5	14.0	6.8	14.5	15.5	10.0
>180	36.4	13.0	0.0	0.0	3.0	26.4	10.0
Total	723.4	573.7	358.2	398.9	89.0	198.0	126.5

* 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	0.9 %	2.3 %	0.4 %	0.8 %
15-35	1.7 %	2.4 %	1.3 %	1.8 %
36-60	-	3.0 %	2.6 %	2.9 %
61-90	-	4.2 %	2.8 %	3.6 %
91-180	3.4 %	5.3 %	4.0 %	4.5 %
>180	4.1 %	5.8 %	4.4 %	4.4 %
Total	1.7 %	2.7 %	1.3 %	1.9 %

*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	16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	144	4620	3741	22	151	3049	2905	12	81	3147	2722
Intragruppo y off-shore***	0	0	1982	1702	0	0	1483	800	0	0	1385	1379
Otros	144	26	541	1700	151	22	639	1466	81	12	744	1175
Total	170	170	7143	7143	173	173	5171	5171	93	93	5276	5276

* 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.