

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 25 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\$1693.2 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	215.8	156.7	78.5	83.1	15.2	69.7	63.0
15-35	451.1	458.2	244.7	172.5	57.5	122.6	156.0
36-60	13.9	11.6	5.0	0.0	6.6	13.9	0.0
61-90	177.5	171.6	96.0	10.0	28.6	120.5	47.0
91-180	72.7	106.6	30.0	30.0	56.6	22.7	20.0
>180	121.5	22.0	21.0	28.5	1.0	93.0	0.0
Total	1052.4	926.7	475.2	324.1	165.6	442.4	286.0

* 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	0.7 %	1.6 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.2 %	1.6 %	0.9 %	1.2 %
36-60	-	2.0 %	1.3 %	1.6 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
91-180	3.3 %	3.4 %	3.3 %	3.4 %
>180	-	4.3 %	4.3 %	4.3 %
Total	1.4 %	2.2 %	1.9 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	175	3743	3345	16	86	3783	3236	15	188	1907	1949
Intragruppo y off-shore***	0	0	1664	1253	0	0	1704	1714	0	0	1123	598
Otros	175	24	706	1514	86	16	792	1329	188	15	475	958
Total	199	199	6113	6113	101	101	6279	6279	203	203	3505	3505

* 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.