

Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 09 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\$1555.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	206.7	261.9	131.3	75.5	80.6	81.2	50.0
15-35	492.5	311.0	106.1	266.0	98.2	119.8	106.8
36-60	107.6	116.7	0.0	0.0	116.7	107.6	0.0
61-90	32.5	23.9	0.0	0.0	23.9	32.5	0.0
91-180	6.4	62.3	35.0	0.0	27.3	6.4	0.0
>180	86.2	4.9	0.0	0.0	4.9	86.2	0.0
Total	932.0	780.7	272.3	341.5	351.6	433.7	156.8

* 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	6.3 %	6.3 %	5.8 %	6.1 %
15-35	6.4 %	6.1 %	6.0 %	6.1 %
36-60	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
61-90	-	13.7 %	5.2 %	8.8 %
91-180	-	5.6 %	3.8 %	5.4 %
>180	-	5.9 %	4.7 %	4.8 %
Total	6.4 %	6.4 %	5.7 %	6.0 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	7 al 11 de noviembre				14 al 18 de noviembre				21 al 25 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	83	2838	2647	41	89	2363	2329	50	109	1954	2491
Intragrupa y off-shore***	0	0	1221	1057	0	0	1181	991	0	0	1273	515
Otros	83	37	761	1115	89	41	699	923	109	50	558	780
Total	120	120	4819	4819	129	129	4243	4243	159	159	3786	3786

* 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.

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.