

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 11 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\$933.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	204.0	218.8	166.9	148.0	6.9	11.0	45.0
15-35	117.2	322.1	253.3	31.8	4.8	21.4	64.0
36-60	20.7	3.3	0.0	0.0	3.3	20.7	0.0
61-90	8.5	16.9	0.0	0.0	16.9	8.5	0.0
91-180	9.4	4.3	0.0	0.0	4.3	9.4	0.0
>180	12.6	105.1	102.6	0.0	2.6	12.6	0.0
Total	372.3	670.5	522.7	179.8	38.8	83.5	109.0

* 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	6.1 %	6.5 %	4.9 %	6.0 %
15-35	4.9 %	5.6 %	4.7 %	5.3 %
36-60	-	7.8 %	4.1 %	4.6 %
61-90	-	5.6 %	4.9 %	5.3 %
91-180	-	5.8 %	4.9 %	5.1 %
>180	-	6.5 %	5.0 %	5.2 %
Total	5.4 %	5.9 %	4.8 %	5.5 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	2650	45	97	2644	2664	53	114	2015	2649
Intragruppo y off-shore***	0	0	1221	1057	0	0	1387	1143	0	0	1424	515
Otros	83	37	764	1115	97	45	725	950	114	53	561	836
Total	120	120	4823	4823	142	142	4757	4757	168	168	4000	4000

* 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.