

Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 15 de noviembre de martes 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\$1773.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	175.1	238.2	135.1	80.2	34.4	26.2	68.7
15-35	453.2	440.5	269.3	282.6	108.7	108.1	62.5
36-60	148.3	74.9	15.0	20.0	29.9	98.3	30.0
61-90	27.2	8.8	0.4	1.0	8.4	26.2	0.0
91-180	100.1	243.9	140.4	9.0	63.4	51.1	40.0
>180	55.6	24.3	0.0	10.0	9.3	30.6	15.0
Total	959.5	1030.5	560.2	402.8	254.2	340.5	216.2

* 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	6.6 %	6.4 %	5.1 %	6.1 %
15-35	6.6 %	6.6 %	6.5 %	6.5 %
36-60	5.6 %	6.1 %	5.2 %	5.5 %
61-90	-	5.8 %	5.1 %	5.3 %
91-180	5.5 %	5.6 %	5.3 %	5.5 %
>180	5.6 %	5.7 %	5.2 %	5.4 %
Total	6.2 %	6.2 %	5.9 %	6.1 %

*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	14 al 18 de noviembre				21 al 25 de noviembre				28 de nov. al 2 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	96	2761	2796	55	117	2068	2743	21	122	2269	2427
Intragruppo y off-shore***	0	0	1467	1217	0	0	1480	521	0	0	1271	760
Otros	96	45	742	957	117	55	567	850	122	21	573	925
Total	141	141	4970	4970	171	171	4114	4114	143	143	4112	4112

* 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.