

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 05 de noviembre de jueves 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\$1412.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	125.9	72.1	25.0	76.9	26.1	28.0	21.0
15-35	419.4	404.9	269.9	76.0	57.4	265.7	77.7
36-60	44.2	47.7	0.0	0.0	47.7	44.2	0.0
61-90	45.1	24.4	0.0	44.0	24.4	1.1	0.0
91-180	182.3	92.1	0.0	30.0	72.1	132.3	20.0
>180	58.3	30.1	10.0	40.0	5.1	3.3	15.0
Total	875.2	671.3	304.9	266.9	232.7	474.6	133.7

* 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 %	1.1 %	0.1 %	0.5 %
15-35	0.5 %	1.3 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	2.2 %	0.5 %	1.4 %
61-90	-	4.2 %	2.6 %	3.2 %
91-180	3.6 %	5.1 %	4.0 %	4.3 %
>180	4.8 %	5.1 %	4.5 %	4.7 %
Total	1.5 %	2.2 %	1.8 %	1.9 %

*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

Sectores	2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	159	3659	3162	23	140	2650	2837	18	164	3723	3645
Intragruppo y off-shore***	0	0	1886	1609	0	0	1633	803	0	0	1848	1197
Otros	159	16	455	1229	140	23	613	1256	164	18	780	1511
Total	175	175	5999	5999	163	163	4896	4896	181	181	6352	6352

* 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.