

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 10 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\$1200.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	253.7	137.3	13.4	116.0	23.9	37.7	100.0
15-35	319.3	373.7	308.1	41.0	15.7	228.3	50.0
36-60	8.3	17.0	15.0	0.0	2.0	8.3	0.0
61-90	58.3	13.4	0.0	0.0	13.4	58.3	0.0
91-180	67.6	69.7	0.0	0.0	69.7	67.6	0.0
>180	16.1	15.7	5.4	5.0	10.3	11.1	0.0
Total	723.2	626.8	341.9	162.0	134.9	411.2	150.0

* 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	2.6 %	2.2 %	5.8 %	4.3 %
15-35	2.8 %	2.5 %	1.8 %	2.2 %
36-60	-	2.9 %	1.0 %	2.3 %
61-90	-	3.6 %	2.5 %	2.7 %
91-180	-	4.8 %	4.0 %	4.4 %
>180	-	5.0 %	4.5 %	4.7 %
Total	2.7 %	3.0 %	3.3 %	3.1 %

*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	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	144	3331	3130	21	161	3917	3842	15	143	2665	2701
Intragrupo y off-shore***	0	0	1789	1290	0	0	1906	1236	0	0	1405	659
Otros	144	27	637	1337	161	21	804	1548	143	15	601	1311
Total	171	171	5757	5757	182	182	6627	6627	158	158	4671	4671

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