

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 11 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\$233.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	38.2	21.2	2.0	20.0	5.2	4.2	14.0
15-35	73.0	104.0	36.0	4.0	14.0	15.0	54.0
36-60	5.5	2.9	0.0	0.0	2.9	5.5	0.0
61-90	0.4	5.5	0.0	0.0	5.5	0.4	0.0
91-180	2.2	13.1	0.0	0.0	13.1	2.2	0.0
>180	33.5	31.7	0.0	0.0	1.7	3.5	30.0
Total	152.8	178.4	38.0	24.0	42.4	30.8	98.0

* 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	3.1 %	3.2 %	-16.1 %	-6.7 %
15-35	2.6 %	3.2 %	2.0 %	2.8 %
36-60	-	4.0 %	2.2 %	2.8 %
61-90	-	4.4 %	2.9 %	4.3 %
91-180	-	4.8 %	3.5 %	4.6 %
>180	4.5 %	5.1 %	4.2 %	4.5 %
Total	3.3 %	3.6 %	-5.4 %	1.4 %

*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	143	3364	3143	21	162	3921	3830	15	145	2679	2715
Intragruppo y off-shore***	0	0	1789	1307	0	0	1908	1239	0	0	1405	659
Otros	143	27	636	1338	162	21	790	1550	145	15	600	1311
Total	170	170	5789	5789	183	183	6619	6619	160	160	4684	4684

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