

Fecha de Publicación: 4 de enero de 2017

Fecha de Información: 02 de enero de lunes 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\$19.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.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	0.5	0.0	0.0	0.0	0.0	0.5	0.0
15-35	1.2	10.4	3.5	0.0	6.9	1.2	0.0
36-60	0.0	4.5	0.0	0.0	4.5	0.0	0.0
61-90	0.0	1.5	0.0	0.0	1.5	0.0	0.0
91-180	0.1	0.7	0.0	0.0	0.7	0.1	0.0
>180	0.0	0.9	0.0	0.0	0.9	0.0	0.0
Total	1.9	18.0	3.5	0.0	14.5	1.9	0.0

* 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	-	8.0 %	5.4 %	5.5 %
15-35	-	7.1 %	3.1 %	6.6 %
36-60	-	6.6 %	6.2 %	6.6 %
61-90	-	7.0 %	-	7.0 %
91-180	-	6.3 %	5.0 %	6.2 %
>180	-	6.7 %	5.7 %	6.7 %
Total	-	6.9 %	3.9 %	6.6 %

*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 enero				9 al 13 de enero				16 al 20 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	61	2275	2599	10	108	2719	2515	13	105	2021	1791
Intragrupa y off-shore***	0	0	1173	789	0	0	1154	1090	0	0	777	723
Otros	61	28	518	542	108	10	667	935	105	13	582	865
Total	89	89	3966	3930	118	118	4540	4540	118	118	3379	3379

* 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.