

Fecha de Publicación: 5 de enero de 2017

Fecha de Información: 03 de enero 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\$1198.8 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	343.9	167.7	10.0	162.6	41.7	65.3	116.0
15-35	341.6	436.1	265.8	156.2	29.1	44.2	141.2
36-60	4.7	8.9	0.0	0.0	8.9	4.7	0.0
61-90	0.8	43.6	30.0	0.0	13.6	0.8	0.0
91-180	25.5	11.1	0.0	25.0	11.1	0.5	0.0
>180	21.7	50.5	45.0	20.0	5.5	1.7	0.0
Total	738.2	717.8	350.8	363.8	109.9	117.2	257.2

* 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 %	6.9 %	6.6 %	6.7 %
15-35	6.6 %	6.7 %	6.1 %	6.5 %
36-60	-	7.1 %	6.4 %	6.8 %
61-90	-	6.8 %	4.6 %	6.7 %
91-180	-	5.7 %	5.5 %	5.7 %
>180	-	5.8 %	5.0 %	5.6 %
Total	6.6 %	6.7 %	6.4 %	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	63	2541	2684	11	108	2789	2581	13	109	2048	1814
Intragrupa y off-shore***	0	0	1173	949	0	0	1154	1093	0	0	787	723
Otros	63	28	513	557	108	11	707	977	109	13	583	881
Total	91	91	4227	4191	119	119	4650	4650	121	121	3418	3418

* 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.