

Fecha de Publicación: 6 de enero de 2017

Fecha de Información: 04 de enero 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\$1469.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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	256.4	200.0	106.0	195.0	34.0	1.4	60.0
15-35	440.4	443.7	269.3	278.3	82.2	69.9	92.3
36-60	48.5	29.6	15.0	43.0	14.6	5.5	0.0
61-90	46.6	68.5	10.0	10.0	58.5	36.6	0.0
91-180	0.1	35.1	5.0	0.0	30.1	0.1	0.0
>180	45.0	13.0	5.0	40.0	3.0	0.0	5.0
Total	837.0	789.8	410.3	566.3	222.3	113.5	157.3

* 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	6.8 %	6.5 %	3.6 %	5.2 %
15-35	6.9 %	6.8 %	6.4 %	6.6 %
36-60	-	6.6 %	6.6 %	6.6 %
61-90	-	6.5 %	6.3 %	6.5 %
91-180	-	6.0 %	6.1 %	6.0 %
>180	5.6 %	5.7 %	5.6 %	5.6 %
Total	6.8 %	6.6 %	5.5 %	6.2 %

* 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

Sector	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	C	V						
Sector Financiero**	28	64	2656	2795	10	110	2905	2628	13	113	2127	1888								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1260	1059	0	0	1159	1177	0	0	836	778								
Otros	64	28	532	558	110	10	717	977	113	13	585	881								
Total	92	92	4448	4412	120	120	4782	4782	126	126	3547	3547								

* 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.