

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2017

Fecha de Información: 05 de enero de jueves 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\$1210.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.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	294.7	296.1	69.0	85.0	47.1	29.7	180.0
15-35	362.1	302.1	152.4	217.0	59.5	54.8	90.3
36-60	16.5	58.6	3.0	0.0	55.6	16.5	0.0
61-90	40.3	38.1	3.0	40.0	35.1	0.3	0.0
91-180	0.2	40.7	0.1	0.0	40.7	0.2	0.0
>180	0.1	31.2	2.3	0.0	28.9	0.1	0.0
Total	713.8	766.9	229.7	342.0	266.9	101.5	270.3

* 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	6.5 %	7.3 %	6.4 %	6.7 %
15-35	6.4 %	6.7 %	6.3 %	6.4 %
36-60	-	6.8 %	6.2 %	6.7 %
61-90	-	6.7 %	6.4 %	6.6 %
91-180	-	6.3 %	5.8 %	6.3 %
>180	-	5.9 %	5.6 %	5.9 %
Total	6.4 %	6.8 %	6.3 %	6.5 %

*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	65	2701	2814	11	111	3101	2827	13	117	2186	1995
Intragrupa y off-shore***	0	0	1260	1104	0	0	1194	1217	0	0	880	778
Otros	65	28	550	558	111	11	736	987	117	13	607	900
Total	93	93	4512	4476	122	122	5030	5030	130	130	3673	3673

* 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.