

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2017

Fecha de Información: 11 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\$1543.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	193.2	158.7	96.0	117.5	44.7	57.7	18.0
15-35	554.5	596.9	274.6	164.3	168.6	236.5	153.8
36-60	57.8	2.2	0.0	40.0	2.2	17.8	0.0
61-90	38.3	50.5	10.0	10.0	15.5	3.3	25.0
91-180	0.8	11.5	0.0	0.0	11.5	0.8	0.0
>180	30.0	75.4	18.0	0.0	27.4	0.0	30.0
Total	874.6	895.2	398.6	331.8	269.9	316.1	226.8

* 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	7.0 %	7.7 %	5.6 %	6.7 %
15-35	7.1 %	8.2 %	6.9 %	7.5 %
36-60	-	8.4 %	6.9 %	6.9 %
61-90	6.5 %	6.8 %	6.4 %	6.6 %
91-180	-	6.8 %	6.1 %	6.8 %
>180	5.6 %	5.6 %	-	5.6 %
Total	6.8 %	7.8 %	6.6 %	7.1 %

* 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	9 al 13 de enero				16 al 20 de enero				23 al 27 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	119	3430	3222	16	116	2321	2126	16	143	2166	2005
Intragrupa y off-shore***	0	0	1516	1362	0	0	943	836	0	0	933	695
Otros	119	12	714	1076	116	16	623	924	143	16	702	1100
Total	131	131	5660	5660	132	132	3887	3887	159	159	3800	3800

* 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.