

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2017

Fecha de Información: 13 de enero de viernes 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\$1385.6 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	226.0	255.3	123.0	108.2	41.3	26.8	91.0
15-35	528.6	402.8	169.0	200.5	56.8	151.1	177.0
36-60	36.2	6.5	0.0	35.0	6.5	1.2	0.0
61-90	11.3	36.1	0.0	0.0	26.1	1.3	10.0
91-180	1.1	15.9	0.0	0.0	15.9	1.1	0.0
>180	63.0	143.9	67.0	0.0	13.9	0.0	63.0
Total	866.2	860.4	359.0	343.7	160.4	181.5	341.0

* 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	6.9 %	6.9 %	5.6 %	6.4 %
15-35	6.7 %	6.8 %	6.6 %	6.7 %
36-60	-	7.5 %	6.7 %	6.8 %
61-90	6.5 %	6.8 %	6.1 %	6.7 %
91-180	-	6.7 %	5.9 %	6.6 %
>180	5.6 %	5.7 %	-	5.7 %
Total	6.5 %	6.6 %	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

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	107	3486	3278	23	117	2610	2351	16	155	2206	2146
Intragrupa y off-shore***	0	0	1558	1408	0	0	1063	994	0	0	1006	696
Otros	107	12	718	1076	117	23	620	947	155	16	738	1108
Total	119	119	5762	5762	140	140	4292	4292	171	171	3950	3950

* 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.