

Fecha de Publicación: 19 de enero de 2017

Fecha de Información: 17 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\$1774.4 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	292.5	249.1	98.5	144.0	18.9	16.8	131.8
15-35	582.7	476.7	207.0	270.5	124.0	166.4	145.8
36-60	228.9	83.0	37.6	59.0	35.4	159.9	10.0
61-90	36.7	24.4	2.0	15.0	22.4	21.7	0.0
91-180	1.0	48.1	1.6	0.0	46.5	1.0	0.0
>180	17.6	25.0	6.5	10.0	14.9	3.9	3.7
Total	1159.3	906.4	353.2	498.5	262.0	369.6	291.2

* 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	6.5 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
15-35	6.6 %	6.6 %	6.5 %	6.6 %
36-60	6.6 %	7.0 %	6.6 %	6.7 %
61-90	-	6.9 %	6.4 %	6.6 %
91-180	-	6.6 %	5.9 %	6.6 %
>180	5.6 %	6.0 %	5.7 %	5.8 %
Total	6.6 %	6.7 %	6.5 %	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

Sector	16 al 20 de enero				23 al 27 de enero				30 de ene. al 3 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	112	2921	2586	15	159	2243	2208	8	89	2511	2344
Intragrupa y off-shore***	0	0	1159	1151	0	0	1037	701	0	0	799	786
Otros	112	23	612	954	159	15	759	1130	89	8	739	920
Total	135	135	4692	4692	174	174	4039	4039	97	97	4049	4049

* 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.