

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2017

Fecha de Información: 18 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\$1125.0 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	209.4	142.5	45.0	107.0	18.4	23.4	79.0
15-35	408.5	322.4	138.0	111.9	86.9	199.0	97.6
36-60	49.2	35.6	0.0	35.3	35.6	13.9	0.0
61-90	21.0	27.5	15.0	10.0	2.5	1.0	10.0
91-180	1.0	13.6	0.0	0.0	13.6	1.0	0.0
>180	53.8	67.1	10.0	10.0	17.1	3.8	40.0
Total	742.9	608.7	208.0	274.2	174.1	242.1	226.6

* 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	7.1 %	7.2 %	6.2 %	6.8 %
15-35	7.0 %	6.7 %	6.6 %	6.7 %
36-60	-	7.3 %	6.5 %	6.9 %
61-90	6.5 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
91-180	-	6.4 %	6.0 %	6.4 %
>180	5.7 %	5.9 %	5.4 %	5.7 %
Total	6.8 %	6.8 %	6.4 %	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	114	3009	2653	18	160	2325	2260	8	89	2548	2385
Intragrupa y off-shore***	0	0	1200	1213	0	0	1041	731	0	0	809	801
Otros	114	23	614	956	160	18	771	1146	89	8	751	922
Total	137	137	4823	4823	178	178	4137	4137	97	97	4108	4108

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.