

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1710.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.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	356.8	208.7	54.6	184.8	11.2	29.1	143.0
15-35	458.5	649.3	377.7	115.5	104.6	176.0	167.0
36-60	98.9	87.3	0.0	0.0	87.3	98.9	0.0
61-90	6.9	46.1	40.0	0.0	6.1	6.9	0.0
91-180	9.1	13.2	0.0	1.8	13.2	7.2	0.0
>180	63.0	22.5	0.0	50.0	22.5	13.0	0.0
Total	993.1	1027.1	472.3	352.1	244.9	331.0	310.0

* 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	6.5 %	7.1 %	6.7 %	6.7 %
15-35	6.3 %	6.3 %	5.8 %	6.1 %
36-60	-	6.6 %	6.1 %	6.3 %
61-90	-	6.5 %	6.4 %	6.5 %
91-180	-	6.4 %	4.8 %	5.8 %
>180	-	5.6 %	5.7 %	5.7 %
Total	6.4 %	6.4 %	6.0 %	6.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	24	114	3165	2718	18	161	2491	2371	8	89	2582	2421
Intragruppo y off-shore***	0	0	1229	1337	0	0	1057	791	0	0	823	802
Otros	114	24	614	953	161	18	780	1165	89	8	752	934
Total	137	137	5007	5007	179	179	4327	4327	97	97	4157	4157

* 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.