

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2017

Fecha de Información: 26 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\$1085.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	121.3	123.4	70.7	38.1	19.8	50.2	33.0
15-35	407.1	318.7	155.7	77.6	150.5	317.0	12.5
36-60	60.8	3.8	0.0	0.0	3.8	60.8	0.0
61-90	23.6	62.9	0.0	0.0	42.2	2.9	20.7
91-180	3.4	17.4	0.1	0.0	17.3	3.4	0.0
>180	1.5	7.4	0.0	0.0	7.4	1.5	0.0
Total	617.8	533.7	226.5	115.7	241.1	435.9	66.2

* 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	6.4 %	6.6 %	6.1 %	6.3 %
15-35	6.4 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	6.6 %	6.3 %	6.3 %
61-90	6.3 %	6.3 %	5.8 %	6.2 %
91-180	-	6.1 %	5.4 %	6.0 %
>180	-	5.7 %	5.4 %	5.7 %
Total	6.3 %	6.5 %	6.3 %	6.4 %

*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	23 al 27 de enero				30 de ene. al 3 de febrero				6 al 10 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	168	2909	2819	9	92	2826	2757	6	81	2174	2147
Intragruppo y off-shore***	0	0	1360	1044	0	0	1016	912	0	0	841	740
Otros	168	21	816	1222	92	9	822	994	81	6	783	886
Total	189	189	5085	5085	102	102	4664	4664	87	87	3798	3773

* 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.