

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2017

Fecha de Información: 27 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\$656.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	145.0	94.3	29.8	77.3	23.5	26.7	41.0
15-35	196.5	165.0	83.8	72.5	67.2	110.0	14.0
36-60	12.6	8.1	0.0	0.7	8.1	12.0	0.0
61-90	30.4	44.8	3.0	10.0	21.8	0.4	20.0
91-180	3.8	16.6	0.0	0.0	16.6	3.8	0.0
>180	5.6	8.5	0.0	0.0	8.5	5.6	0.0
Total	393.9	337.3	116.5	160.4	145.8	158.5	75.0

* 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	6.0 %	6.4 %	5.9 %	6.0 %
15-35	6.1 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
36-60	-	6.8 %	5.6 %	6.1 %
61-90	5.9 %	6.3 %	6.0 %	6.1 %
91-180	-	6.1 %	5.8 %	6.0 %
>180	-	5.9 %	5.1 %	5.6 %
Total	6.0 %	6.3 %	6.0 %	6.1 %

*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

Sector	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	167	2909	2819	12	92	2889	2785	10	81	2251	2213
Intragruppo y off-shore***	0	0	1360	1044	0	0	1026	968	0	0	861	761
Otros	167	21	817	1222	92	12	839	1001	81	10	788	901
Total	188	188	5086	5086	103	103	4755	4755	92	92	3900	3875

* 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.