

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 29 de noviembre 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\$1495.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	254.6	274.0	159.5	128.3	42.5	54.4	72.0
15-35	295.0	415.0	195.3	111.3	115.7	79.7	104.0
36-60	109.4	58.3	46.6	66.5	11.7	42.9	0.0
61-90	112.0	93.0	0.0	68.0	72.0	23.0	21.0
91-180	23.7	29.9	0.0	9.0	21.8	6.6	8.1
>180	4.8	31.3	0.0	0.0	31.3	4.8	0.0
Total	799.5	901.5	401.4	383.1	295.0	211.4	205.1

* 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	8.1 %	8.2 %	7.2 %	7.8 %
15-35	5.2 %	6.0 %	7.8 %	6.4 %
36-60	-	7.1 %	6.2 %	6.6 %
61-90	6.5 %	6.6 %	6.2 %	6.4 %
91-180	5.7 %	6.3 %	5.6 %	6.1 %
>180	-	5.8 %	5.3 %	5.7 %
Total	6.3 %	6.8 %	7.0 %	6.8 %

*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

Sectores	28 de nov. al 2 de diciembre				5 al 9 de diciembre				12 al 16 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	123	3388	4202	24	84	2261	2595	48	120	2734	3147
Intragrupa y off-shore***	0	0	2174	1191	0	0	1297	955	0	0	1420	1149
Otros	123	46	998	1167	84	24	771	779	120	48	1089	936
Total	169	169	6560	6560	108	108	4328	4328	168	168	5242	5232

* 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.