

Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 30 de noviembre 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\$1824.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.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	324.3	412.0	238.0	189.9	118.1	78.4	56.0
15-35	417.6	467.8	229.5	256.1	110.4	33.5	128.0
36-60	27.6	30.4	0.0	0.0	30.4	27.6	0.0
61-90	29.4	90.0	0.8	2.5	75.2	12.9	14.0
91-180	15.4	59.5	0.0	13.1	59.5	2.3	0.0
>180	47.5	107.2	2.9	0.0	98.3	41.5	6.0
Total	861.8	1166.9	471.1	461.5	491.8	196.2	204.0

* 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	9.2 %	8.0 %	7.0 %	7.7 %
15-35	8.1 %	8.1 %	7.4 %	7.9 %
36-60	-	8.0 %	5.9 %	7.0 %
61-90	6.7 %	6.6 %	6.6 %	6.6 %
91-180	-	6.5 %	5.6 %	6.4 %
>180	5.4 %	5.8 %	5.6 %	5.8 %
Total	8.2 %	7.6 %	6.9 %	7.5 %

*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	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**	47	117	3583	4280	24	88	2366	2776	48	131	2807	3348
Intragrupa y off-shore***	0	0	2189	1345	0	0	1399	983	0	0	1541	1179
Otros	117	47	1029	1178	88	24	831	836	131	48	1152	964
Total	164	164	6802	6802	112	112	4595	4595	180	180	5500	5490

* 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.