

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$1386.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.7%.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	136.8	289.6	176.8	34.5	51.9	41.3	61.0
15-35	332.0	516.2	292.0	102.0	19.2	25.0	205.0
36-60	75.0	31.1	0.0	37.8	31.1	37.1	0.0
61-90	23.6	11.8	0.0	0.0	11.8	23.6	0.0
91-180	26.6	76.9	30.0	15.0	36.9	1.6	10.0
>180	39.3	120.0	60.0	20.0	44.0	3.3	16.0
Total	633.3	1045.5	558.8	209.3	194.7	131.9	292.0

* 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	8.9 %	8.0 %	7.7 %	8.2 %
15-35	8.4 %	8.0 %	8.3 %	8.2 %
36-60	-	7.3 %	7.4 %	7.4 %
61-90	-	7.1 %	6.3 %	6.6 %
91-180	6.9 %	6.6 %	6.4 %	6.6 %
>180	5.8 %	5.9 %	4.7 %	5.9 %
Total	8.3 %	7.5 %	7.7 %	7.7 %

* 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	119	3630	4330	25	86	2426	2877	49	132	2836	3490
Intragrupa y off-shore***	0	0	2201	1355	0	0	1449	1003	0	0	1661	1185
Otros	119	46	1044	1191	86	25	846	840	132	49	1174	986
Total	165	165	6876	6876	111	111	4720	4720	182	182	5671	5661

* 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.