

Fecha de Publicación: 6 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 02 de diciembre 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\$1062.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	172.2	198.7	126.7	103.7	36.5	32.9	35.5
15-35	274.8	276.5	130.5	121.5	16.5	23.8	129.5
36-60	30.7	19.0	0.0	0.0	19.0	30.7	0.0
61-90	115.5	116.3	56.0	30.0	10.3	35.5	50.0
91-180	5.2	29.6	0.1	0.0	28.4	4.1	1.0
>180	23.6	16.0	0.0	0.0	16.0	23.6	0.0
Total	621.9	656.1	313.3	255.2	126.8	150.7	216.0

* 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	8.3 %	15.5 %	8.1 %	10.7 %
15-35	8.6 %	8.8 %	8.3 %	8.6 %
36-60	-	8.3 %	7.5 %	7.8 %
61-90	7.3 %	7.3 %	7.0 %	7.2 %
91-180	-6.0 %	6.8 %	5.7 %	6.2 %
>180	-	6.1 %	5.6 %	5.8 %
Total	8.2 %	9.5 %	7.6 %	8.5 %

*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**	45	119	3629	4330	27	92	2555	2996	49	133	2886	3565
Intragrupos y off-shore***	0	0	2201	1355	0	0	1514	1084	0	0	1722	1208
Otros	119	45	1044	1190	92	27	874	863	133	49	1178	1004
Total	164	164	6875	6875	118	118	4942	4942	182	182	5787	5777

* 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.