

Fecha de Publicación: 9 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 06 de diciembre 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\$1986.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	220.6	243.8	103.9	132.7	58.9	6.9	81.0
15-35	570.6	509.6	242.0	267.5	50.5	86.1	217.0
36-60	178.7	138.7	68.0	78.0	70.0	100.0	0.7
61-90	142.1	143.4	11.0	0.0	82.4	92.1	50.0
91-180	6.2	53.9	1.9	0.0	50.9	5.1	1.1
>180	52.9	86.1	20.0	10.0	56.1	32.9	10.0
Total	1170.9	1175.4	446.9	488.2	368.8	323.0	359.8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9.2 %	9.6 %	6.5 %	8.5 %
15-35	9.0 %	8.8 %	8.8 %	8.8 %
36-60	8.8 %	7.9 %	7.6 %	7.7 %
61-90	7.5 %	7.3 %	7.0 %	7.2 %
91-180	6.2 %	7.3 %	6.3 %	7.2 %
>180	6.3 %	6.1 %	6.1 %	6.1 %
Total	-	8.2 %	7.8 %	8.1 %

* 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	5 al 9 de diciembre				12 al 16 de diciembre				19 al 23 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	100	2860	3151	50	134	3073	3880	20	160	2355	3111
Intragruppo y off-shore***	0	0	1595	1285	0	0	1855	1250	0	0	1625	1085
Otros	100	26	873	885	134	50	1307	1095	160	20	691	465
Total	126	126	5328	5320	184	184	6234	6224	179	179	4670	4660

* 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 intragruppo.