

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 15 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\$1305.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	151.6	107.4	83.0	112.0	14.4	29.6	10.0
15-35	352.8	295.6	198.1	220.8	74.5	109.1	23.0
36-60	37.7	50.7	0.0	0.0	50.7	37.7	0.0
61-90	90.8	82.2	50.9	0.0	31.3	90.8	0.0
91-180	5.3	54.8	10.0	5.0	44.8	0.3	0.0
>180	33.0	76.7	34.0	0.0	42.7	33.0	0.0
Total	671.3	667.3	376.0	337.8	258.4	300.6	33.0

* 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	7.6 %	8.7 %	8.0 %	8.2 %
15-35	6.1 %	7.7 %	7.5 %	7.5 %
36-60	-	7.6 %	7.3 %	7.5 %
61-90	-	6.8 %	6.3 %	6.5 %
91-180	-	6.6 %	6.4 %	6.5 %
>180	-	5.8 %	5.9 %	5.8 %
Total	6.6 %	7.2 %	7.2 %	7.2 %

* 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	12 al 16 de diciembre												19 al 23 de diciembre				26 al 30 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V				
Sector Financiero**	27	136	3909	4305	41	172	2712	3487	20	135	1242	1504								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2081	1802	0	0	1854	1290	0	0	728	638								
Otros	135	27	1367	1239	172	41	809	587	135	20	395	224								
Total	162	163	7356	7346	214	214	5374	5364	156	156	2365	2365								

* 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.