

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 23 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\$466.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.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	76.7	37.3	13.5	54.1	9.8	8.6	14.0
15-35	132.3	197.1	144.7	68.5	13.4	24.8	39.0
36-60	5.2	9.8	0.0	0.0	9.8	5.2	0.0
61-90	18.8	12.8	0.0	0.0	12.8	18.8	0.0
91-180	18.2	7.5	0.0	8.0	7.5	10.2	0.0
>180	1.6	2.8	0.0	0.0	2.8	1.6	0.0
Total	252.7	267.2	158.2	130.6	56.0	69.1	53.0

* 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 %	7.5 %	6.9 %	7.4 %
15-35	7.0 %	6.8 %	6.8 %	6.8 %
36-60	-	7.5 %	4.9 %	6.6 %
61-90	-	8.0 %	6.0 %	6.8 %
91-180	-	6.3 %	5.9 %	6.1 %
>180	-	5.7 %	5.2 %	5.5 %
Total	7.5 %	7.0 %	6.6 %	6.9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de diciembre				26 al 30 de diciembre				2 al 6 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	188	3264	3657	25	148	1449	1648	15	57	2030	2379
Intragruppo y off-shore***	0	0	1942	1762	0	0	767	771	0	0	1077	715
Otros	188	40	823	601	148	25	465	261	57	15	486	463
Total	228	228	6029	6019	174	174	2680	2680	72	72	3593	3557

* 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.