

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 26 de diciembre de lunes 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\$35.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.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	1.7	4.2	3.0	0.0	1.2	1.7	0.0
15-35	3.3	2.9	0.0	3.0	2.9	0.3	0.0
36-60	4.4	1.0	0.0	0.0	1.0	4.4	0.0
61-90	0.1	0.6	0.0	0.0	0.6	0.1	0.0
91-180	6.8	8.9	0.0	0.0	8.9	6.8	0.0
>180	1.1	0.8	0.0	0.0	0.8	1.1	0.0
Total	17.3	18.4	3.0	3.0	15.4	14.3	0.0

* 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	-	7.4 %	6.6 %	6.9 %
15-35	-	7.6 %	5.9 %	7.4 %
36-60	-	7.1 %	6.5 %	6.6 %
61-90	-	6.9 %	5.8 %	6.8 %
91-180	-	6.7 %	6.0 %	6.4 %
>180	-	6.1 %	5.3 %	5.6 %
Total	-	6.9 %	6.1 %	6.6 %

*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	26 al 30 de diciembre				2 al 6 de enero				9 al 13 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	155	1448	1651	16	55	2031	2381	7	103	2622	2366
Intragruppo y off-shore***	0	0	770	771	0	0	1077	715	0	0	1118	1058
Otros	155	25	465	260	55	16	487	464	103	7	609	924
Total	180	180	2683	2683	71	71	3595	3559	110	110	4349	4349

* 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.