

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 27 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\$673.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.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	117.7	41.8	10.0	51.4	1.8	36.3	30.0
15-35	305.2	216.8	92.8	204.0	43.4	20.7	80.5
36-60	3.0	3.2	0.0	0.0	3.2	3.0	0.0
61-90	60.2	21.5	0.0	40.0	21.5	20.2	0.0
91-180	0.7	6.5	0.0	0.0	6.5	0.7	0.0
>180	0.3	6.5	0.0	0.0	6.5	0.3	0.0
Total	487.2	296.3	102.8	295.4	83.0	81.3	110.5

* 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	8.1 %	11.3 %	5.8 %	7.0 %
15-35	6.8 %	6.4 %	6.5 %	6.5 %
36-60	-	7.3 %	6.1 %	6.7 %
61-90	-	7.4 %	5.3 %	5.8 %
91-180	-	6.6 %	6.0 %	6.6 %
>180	-	5.9 %	5.6 %	5.9 %
Total	7.1 %	6.7 %	6.2 %	6.5 %

*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

Sector	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	1465	1658	22	55	2125	2413	7	106	2655	2463
Intragruppo y off-shore***	0	0	777	783	0	0	1080	754	0	0	1154	1058
Otros	155	25	465	265	55	22	487	489	106	7	640	928
Total	179	179	2707	2707	77	77	3692	3656	112	112	4450	4450

* 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.