

Fecha de Publicación: 2 de enero de 2017

Fecha de Información: 28 de diciembre de miércoles 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\$815.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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	135.1	107.0	40.0	4.5	10.0	73.6	57.0
15-35	325.2	316.7	83.5	100.0	79.2	71.2	154.0
36-60	3.9	3.3	0.0	0.0	3.3	3.9	0.0
61-90	34.9	11.9	5.0	0.0	6.9	34.9	0.0
91-180	13.3	16.4	0.0	0.0	6.4	3.3	10.0
>180	22.6	65.8	25.0	0.0	20.8	2.6	20.0
Total	535.2	521.1	153.5	104.5	126.6	189.7	241.0

* 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	9.2 %	8.1 %	1.2 %	5.3 %
15-35	6.2 %	7.1 %	6.5 %	6.6 %
36-60	-	9.3 %	4.8 %	6.9 %
61-90	-	6.7 %	5.9 %	6.0 %
91-180	5.9 %	6.9 %	5.2 %	6.1 %
>180	5.3 %	5.5 %	4.7 %	5.4 %
Total	6.8 %	6.9 %	5.0 %	6.2 %

*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	157	1478	1659	27	54	2225	2505	10	104	2677	2498
Intragruppo y off-shore***	0	0	777	788	0	0	1120	754	0	0	1154	1063
Otros	157	25	466	274	54	27	492	542	104	10	665	935
Total	182	182	2721	2721	81	81	3836	3800	114	114	4496	4496

* 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.