

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2017

Fecha de Información: 25 de enero 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\$978.5 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	171.8	161.8	88.0	101.0	25.8	22.8	48.0
15-35	303.2	314.6	165.0	80.0	63.6	137.2	86.0
36-60	2.1	3.9	0.0	0.0	3.9	2.1	0.0
61-90	53.0	27.6	0.0	0.0	27.6	53.0	0.0
91-180	3.7	17.7	0.0	0.0	17.7	3.7	0.0
>180	36.6	36.4	0.0	10.0	16.4	6.6	20.0
Total	570.5	562.0	253.0	191.0	155.0	225.5	154.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.6 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
15-35	6.6 %	6.7 %	6.3 %	6.6 %
36-60	-	7.0 %	6.1 %	6.7 %
61-90	-	6.5 %	6.2 %	6.3 %
91-180	-	6.1 %	5.9 %	6.1 %
>180	5.7 %	5.8 %	5.3 %	5.6 %
Total	6.5 %	6.6 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de enero				30 de ene. al 3 de febrero				6 al 10 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	168	2850	2792	9	93	2793	2689	6	79	2146	2110
Intragrupo y off-shore***	0	0	1336	1013	0	0	970	905	0	0	831	740
Otros	168	19	816	1197	93	9	812	981	79	6	773	876
Total	186	186	5002	5002	102	102	4575	4575	85	85	3750	3725

* 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.