

Fecha de Publicación: 2 de febrero de 2017

Fecha de Información: 31 de enero 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\$1519.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.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	237.9	108.7	82.0	205.6	9.7	15.3	17.0
15-35	503.9	450.2	230.0	243.2	104.2	144.7	116.0
36-60	4.4	28.2	0.0	0.0	28.2	4.4	0.0
61-90	42.8	30.3	0.0	30.0	25.3	7.8	5.0
91-180	46.2	103.8	0.0	0.0	103.8	46.2	0.0
>180	69.3	82.2	10.0	0.0	22.2	19.3	50.0
Total	904.5	803.4	322.0	478.8	293.4	237.7	188.0

* 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	6.4 %	6.5 %	6.1 %	6.3 %
15-35	6.3 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %
36-60	-	6.6 %	5.8 %	6.5 %
61-90	6.0 %	6.8 %	6.1 %	6.4 %
91-180	-	6.4 %	6.4 %	6.4 %
>180	5.8 %	5.9 %	5.6 %	5.8 %
Total	6.2 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %

*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	30 de ene. al 3 de febrero				6 al 10 de febrero				13 al 17 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	85	3075	2910	11	91	2346	2244	11	118	2971	2428
Intragruppo y off-shore***	0	0	1117	1108	0	0	862	829	0	0	1007	1183
Otros	85	12	843	1017	91	11	804	913	118	11	735	1102
Total	97	97	5035	5035	102	102	4012	3987	128	128	4713	4713

* 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.