

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2017

Fecha de Información: 01 de febrero 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\$1787.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	331.5	185.4	31.0	197.0	36.4	16.5	118.0
15-35	566.4	574.3	235.5	285.5	96.8	38.9	242.0
36-60	2.2	17.1	0.1	0.0	17.0	2.2	0.0
61-90	80.5	14.8	0.0	50.0	14.8	30.5	0.0
91-180	152.8	144.4	0.0	40.0	137.3	105.7	7.0
>180	56.0	64.0	20.0	21.0	9.0	0.0	35.0
Total	1189.3	1000.0	286.6	593.5	311.3	193.8	402.0

* 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	6.0 %	7.5 %	6.3 %	6.4 %
15-35	5.9 %	6.2 %	6.0 %	6.1 %
36-60	-	6.6 %	5.6 %	6.5 %
61-90	-	6.7 %	6.1 %	6.2 %
91-180	6.1 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
>180	5.7 %	5.7 %	5.8 %	5.7 %
Total	5.9 %	6.3 %	6.0 %	6.1 %

*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**	13	85	3169	2877	11	97	2550	2345	11	122	3046	2554
Intragruppo y off-shore***	0	0	1124	1187	0	0	876	948	0	0	1036	1183
Otros	85	13	788	1018	97	11	817	926	122	11	767	1112
Total	98	98	5081	5081	107	107	4243	4218	133	133	4849	4849

* 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.