

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2017

Fecha de Información: 02 de marzo de jueves 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\$2015.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	425.3	309.4	123.0	143.0	36.4	132.3	150.0
15-35	603.9	629.5	382.1	167.3	57.9	247.0	189.6
36-60	20.4	4.9	0.0	0.0	4.9	20.4	0.0
61-90	4.4	16.6	0.0	0.0	16.6	4.4	0.0
91-180	16.3	21.6	0.0	10.0	21.6	6.3	0.0
>180	120.3	220.1	110.0	8.7	72.1	73.6	38.0
Total	1190.6	1202.1	615.1	329.0	209.5	484.0	377.6

* 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	5.8 %	5.4 %	5.2 %	5.4 %
15-35	5.6 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %
36-60	-	5.6 %	5.0 %	5.1 %
61-90	-	5.6 %	5.1 %	5.5 %
91-180	-	5.6 %	5.2 %	5.4 %
>180	5.1 %	5.3 %	5.2 %	5.2 %
Total	5.6 %	5.5 %	5.3 %	5.5 %

*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

Sectores	27 de feb. al 3 de marzo				6 al 10 de marzo				13 al 17 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	114	4874	4129	23	94	3715	3020	28	122	3587	3447
Intragruppo y off-shore***	0	0	1842	1974	0	0	1125	1342	0	0	1537	1284
Otros	114	31	1096	1710	94	23	1058	1537	122	28	1052	1444
Total	144	144	7813	7813	117	117	5898	5898	150	150	6176	6176

* 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.