

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2017

Fecha de Información: 06 de febrero de lunes 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\$946.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	191.9	170.3	128.4	122.0	1.9	29.8	40.0
15-35	314.6	200.8	39.6	117.9	118.3	153.8	43.0
36-60	3.1	38.9	6.3	0.0	32.6	3.1	0.0
61-90	0.6	14.4	0.0	0.0	14.4	0.6	0.0
91-180	26.2	44.3	0.1	2.2	44.3	24.0	0.0
>180	8.2	15.6	0.0	0.0	15.6	8.2	0.0
Total	544.6	484.3	174.3	242.1	227.1	219.6	83.0

* 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 %	6.3 %	5.4 %	5.9 %
15-35	5.9 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
36-60	-	6.6 %	5.3 %	6.4 %
61-90	-	6.5 %	5.8 %	6.5 %
91-180	-	6.1 %	5.7 %	6.0 %
>180	-	5.9 %	5.4 %	5.7 %
Total	5.9 %	6.3 %	5.7 %	6.0 %

*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	6 al 10 de febrero				13 al 17 de febrero				20 al 24 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	100	2837	2578	11	130	3353	2863	21	132	2436	2502
Intragruppo y off-shore***	0	0	1010	1076	0	0	1129	1243	0	0	1268	978
Otros	99	11	836	1003	130	11	802	1178	132	21	823	1041
Total	111	111	4682	4657	140	140	5284	5284	152	152	4527	4522

* 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.