

Fecha de Publicación: 9 de febrero de 2017

Fecha de Información: 07 de febrero de 2017 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\$946.3 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	109.5	127.1	80.0	48.5	8.1	22.0	39.0
15-35	348.0	346.8	183.5	118.5	68.3	134.5	95.0
36-60	3.6	7.0	0.0	0.0	7.0	3.6	0.0
61-90	23.6	12.8	0.0	20.0	12.8	3.6	0.0
91-180	35.7	22.9	0.0	0.0	22.9	35.7	0.0
>180	40.0	43.2	0.2	0.0	3.1	0.0	40.0
Total	560.4	559.9	263.7	187.0	122.2	199.4	174.0

* 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 %	5.5 %	6.0 %
15-35	6.1 %	6.2 %	6.0 %	6.1 %
36-60	6.3 %	6.8 %	5.4 %	6.3 %
61-90	-	6.3 %	6.0 %	6.1 %
91-180	-	6.3 %	5.9 %	6.0 %
>180	5.4 %	6.2 %	-	5.5 %
Total	5.9 %	6.3 %	5.9 %	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	102	2880	2619	11	133	3423	2940	21	131	2474	2524
Intragruppo y off-shore***	0	0	1039	1092	0	0	1180	1276	0	0	1278	1006
Otros	102	11	830	1012	133	11	806	1193	131	21	827	1044
Total	114	114	4748	4723	144	144	5409	5409	152	152	4579	4574

* 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.