

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2017

Fecha de Información: 08 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\$1602.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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	323.5	283.6	123.5	179.9	38.1	21.5	122.0
15-35	462.2	582.4	349.5	197.4	93.9	125.8	139.0
36-60	24.0	2.2	0.0	10.0	2.2	14.0	0.0
61-90	21.6	8.8	0.0	0.0	8.8	21.6	0.0
91-180	44.4	76.3	0.0	0.0	76.3	44.4	0.0
>180	3.8	30.8	0.0	0.0	30.8	3.8	0.0
Total	879.5	984.1	473.0	387.3	250.1	231.2	261.0

* 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	6.3 %	6.8 %	5.4 %	6.3 %
15-35	6.2 %	6.6 %	6.0 %	6.3 %
36-60	-	7.0 %	5.3 %	5.4 %
61-90	-	7.0 %	6.0 %	6.3 %
91-180	-	6.1 %	5.8 %	6.0 %
>180	-	5.9 %	5.3 %	5.8 %
Total	6.2 %	6.5 %	5.8 %	6.2 %

*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	97	3028	2686	11	130	3549	3116	21	134	2528	2608
Intragruppo y off-shore***	0	0	1094	1228	0	0	1246	1314	0	0	1315	1014
Otros	97	11	830	1014	130	11	846	1212	134	21	833	1049
Total	108	108	4953	4928	141	141	5641	5641	155	155	4676	4671

* 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.