

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2017

Fecha de Información: 09 de febrero 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\$1688.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	204.3	185.5	51.3	75.7	44.3	38.6	90.0
15-35	733.9	562.0	176.5	261.5	214.6	301.4	171.0
36-60	8.8	9.3	0.0	0.0	7.1	6.5	2.3
61-90	90.9	67.2	0.0	30.0	17.2	10.9	50.0
91-180	0.0	43.4	10.0	0.0	33.4	0.0	0.0
>180	75.8	85.9	5.0	10.0	15.9	0.8	65.0
Total	1113.7	953.3	242.7	377.2	332.3	358.2	378.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.4 %	6.1 %	6.0 %	6.1 %
15-35	6.3 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
36-60	6.2 %	6.8 %	5.9 %	6.4 %
61-90	6.0 %	6.5 %	5.7 %	6.0 %
91-180	-	6.2 %	-	6.2 %
>180	5.6 %	5.8 %	5.5 %	5.6 %
Total	6.2 %	6.1 %	5.8 %	6.0 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	92	3031	2700	21	138	3605	3198	22	134	2663	2693
Intragruppo y off-shore***	0	0	1098	1229	0	0	1277	1324	0	0	1331	1079
Otros	92	11	840	1016	138	21	862	1222	134	22	846	1064
Total	103	103	4969	4944	160	160	5744	5744	156	156	4841	4836

* 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.

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 intragruppo.