

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2017

Fecha de Información: 14 de febrero de martes 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\$1209.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.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 | 186.3 | 360.6 | 186.3 | 39.5 | 54.4 | 26.8 | 120.0 |
| 15-35 | 341.3 | 275.2 | 92.2 | 146.0 | 55.7 | 68.0 | 127.3 |
| 36-60 | 23.5 | 9.3 | 0.0 | 22.0 | 9.3 | 1.5 | 0.0 |
| 61-90 | 54.3 | 48.5 | 0.0 | 25.0 | 48.5 | 29.3 | 0.0 |
| 91-180 | 0.5 | 16.1 | 0.0 | 0.0 | 16.1 | 0.5 | 0.0 |
| >180 | 104.1 | 107.5 | 0.0 | 0.0 | 37.5 | 34.1 | 70.0 |
| Total | 710.0 | 817.2 | 278.5 | 232.5 | 221.5 | 160.2 | 317.3 |

* 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 | 6.6 % | 6.8 % | 5.7 % | 6.6 % |
| 15-35 | 6.4 % | 6.6 % | 6.2 % | 6.4 % |
| 36-60 | - | 6.8 % | 6.2 % | 6.3 % |
| 61-90 | - | 6.7 % | 6.3 % | 6.5 % |
| 91-180 | - | 6.8 % | 5.7 % | 6.7 % |
| >180 | 5.6 % | 6.3 % | 6.2 % | 5.9 % |
| Total | 6.3 % | 6.7 % | 6.2 % | 6.4 % |

*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 | 13 al 17 de febrero | | | | 20 al 24 de febrero | | | | 27 de feb. al 3 de marzo | | | |
|----------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 141 | 3840 | 3713 | 22 | 136 | 2884 | 2972 | 25 | 102 | 3718 | 2782 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1656 | 1416 | 0 | 0 | 1423 | 1141 | 0 | 0 | 1138 | 1477 |
| Otros | 141 | 22 | 892 | 1260 | 136 | 22 | 902 | 1092 | 102 | 25 | 858 | 1455 |
| Total | 163 | 163 | 6389 | 6389 | 158 | 158 | 5209 | 5204 | 127 | 127 | 5714 | 5714 |

* 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.