

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2017

Fecha de Información: 15 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\$1793.2 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	318.0	200.2	103.5	227.8	23.7	17.2	73.0
15-35	386.5	569.1	300.6	100.3	161.5	179.2	107.1
36-60	42.7	13.4	0.0	30.3	3.4	2.4	10.0
61-90	171.7	11.2	0.0	50.0	11.2	121.7	0.0
91-180	0.2	26.1	0.0	0.0	26.1	0.2	0.0
>180	117.0	167.1	0.0	20.0	127.1	57.0	40.0
Total	1036.1	987.2	404.1	428.4	353.0	377.7	230.1

* 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	6.5 %	6.5 %	6.0 %	6.3 %
15-35	6.3 %	6.2 %	5.9 %	6.1 %
36-60	6.4 %	7.1 %	6.4 %	6.5 %
61-90	-	6.8 %	6.2 %	6.3 %
91-180	-	6.6 %	5.9 %	6.6 %
>180	5.5 %	6.1 %	5.9 %	5.9 %
Total	6.2 %	6.3 %	6.0 %	6.2 %

*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	138	4009	3779	22	136	2979	3074	26	104	3812	2864
Intragrupa y off-shore***	0	0	1686	1547	0	0	1477	1191	0	0	1184	1524
Otros	138	22	893	1262	136	22	920	1106	104	26	860	1468
Total	160	160	6587	6587	158	158	5375	5370	130	130	5856	5856

* 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 intragrupo.