

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2017

Fecha de Información: 16 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\$1695.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.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	252.0	141.1	29.5	133.5	12.9	19.8	98.7
15-35	518.3	572.1	352.3	182.1	73.4	189.7	146.5
36-60	32.9	34.5	0.0	0.0	34.5	32.9	0.0
61-90	171.7	46.6	15.0	142.0	8.6	6.7	23.0
91-180	59.6	63.8	0.0	0.0	43.8	39.6	20.0
>180	86.0	12.9	0.0	40.0	5.4	38.5	7.5
Total	1120.4	871.0	396.8	497.6	178.6	327.1	295.7

* 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	6.7 %	6.7 %	6.2 %	6.5 %
15-35	6.5 %	6.5 %	6.3 %	6.4 %
36-60	-	6.4 %	6.3 %	6.4 %
61-90	6.1 %	6.3 %	6.2 %	6.2 %
91-180	6.3 %	6.2 %	6.0 %	6.1 %
>180	6.1 %	6.3 %	5.7 %	5.8 %
Total	6.5 %	6.5 %	6.2 %	6.3 %

*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

Sectores	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	4056	3804	21	137	3130	3132	28	106	3865	2914
Intragruppo y off-shore***	0	0	1690	1582	0	0	1485	1267	0	0	1202	1547
Otros	141	22	893	1255	137	21	918	1129	106	28	865	1471
Total	163	163	6640	6640	158	158	5533	5528	134	134	5932	5932

* 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.