

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2017

Fecha de Información: 17 de febrero de viernes 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\$1342.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.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	264.0	235.9	83.0	103.0	29.9	38.0	123.0
15-35	404.9	421.5	259.0	118.5	35.6	159.4	127.0
36-60	17.7	21.0	0.0	0.0	8.0	4.7	13.0
61-90	5.3	8.5	0.0	0.0	8.5	5.3	0.0
91-180	86.5	86.4	0.0	10.0	86.4	76.5	0.0
>180	45.8	18.1	0.0	30.0	8.1	5.8	10.0
Total	824.2	791.5	342.0	261.5	176.5	289.7	273.0

* 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	6.6 %	10.6 %	6.1 %	7.8 %
15-35	6.5 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %
36-60	6.1 %	6.8 %	6.1 %	6.3 %
61-90	-	6.6 %	6.2 %	6.5 %
91-180	-	6.3 %	6.2 %	6.3 %
>180	6.1 %	6.3 %	6.0 %	6.1 %
Total	6.5 %	7.4 %	6.2 %	6.8 %

*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	139	4056	3805	21	138	3345	3238	28	106	3914	3047
Intragruppo y off-shore***	0	0	1690	1582	0	0	1503	1370	0	0	1267	1547
Otros	139	22	895	1255	138	21	929	1165	106	28	887	1474
Total	161	161	6641	6641	159	159	5777	5772	134	134	6067	6067

* 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.