

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2017

Fecha de Información: 24 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\$834.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	124.4	80.3	34.0	40.0	2.3	40.4	44.0
15-35	371.3	300.9	120.3	134.5	39.6	95.8	141.0
36-60	14.4	6.0	0.0	0.0	6.0	14.4	0.0
61-90	6.7	9.0	0.4	0.0	8.6	6.7	0.0
91-180	25.1	48.1	0.0	0.0	23.1	0.1	25.0
>180	29.1	51.9	20.0	0.0	8.9	6.1	23.0
Total	570.9	496.2	174.7	174.5	88.5	163.4	233.0

* 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	6.0 %	6.1 %	5.3 %	5.7 %
15-35	6.0 %	6.2 %	5.8 %	6.0 %
36-60	-	6.5 %	5.8 %	6.0 %
61-90	-	6.3 %	5.9 %	6.1 %
91-180	6.0 %	6.6 %	5.3 %	6.2 %
>180	5.5 %	5.7 %	5.6 %	5.6 %
Total	5.9 %	6.2 %	5.7 %	5.9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

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

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	20 al 24 de febrero				27 de feb. al 3 de marzo				6 al 10 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	130	3716	3432	32	104	4335	3493	17	91	3179	2590
Intragruppo y off-shore***	0	0	1657	1691	0	0	1515	1772	0	0	959	1167
Otros	130	21	936	1181	104	32	937	1522	91	17	1040	1422
Total	151	151	6309	6304	136	136	6787	6787	108	108	5179	5179

* 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.