

Fecha de Publicación: 1 de marzo de 2017

Fecha de Información: 27 de febrero de lunes 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\$1583.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	192.9	216.7	160.6	106.5	3.6	34.0	52.5
15-35	563.2	478.6	177.8	228.9	222.4	255.9	78.5
36-60	8.0	6.4	0.0	0.0	6.4	8.0	0.0
61-90	2.1	2.2	0.0	0.0	2.2	2.1	0.0
91-180	12.9	20.8	0.0	0.0	10.8	2.9	10.0
>180	157.0	98.7	0.0	85.0	63.7	37.0	35.0
Total	936.1	823.3	338.4	420.4	309.0	339.8	175.9

* 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	5.6 %	6.4 %	5.1 %	5.8 %
15-35	5.8 %	5.4 %	5.9 %	5.7 %
36-60	-	6.2 %	5.8 %	6.0 %
61-90	-	6.3 %	5.9 %	6.1 %
91-180	5.6 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
>180	5.5 %	5.7 %	5.1 %	5.4 %
Total	5.7 %	5.7 %	5.6 %	5.7 %

*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	27 de feb. al 3 de marzo				6 al 10 de marzo				13 al 17 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	110	4419	3672	17	92	3256	2624	27	118	3137	3125
Intragrupoy off-shore***	0	0	1676	1827	0	0	959	1205	0	0	1424	1206
Otros	110	30	933	1530	91	17	1043	1430	118	27	1059	1289
Total	140	140	7028	7028	109	109	5259	5259	145	145	5620	5620

* 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.