

Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2017

Fecha de Información: 28 de febrero de martes 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\$1697.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	338.2	270.7	127.7	117.3	4.0	81.9	139.0
15-35	643.9	438.2	238.0	179.7	95.0	359.0	105.2
36-60	12.1	29.1	20.0	0.0	9.1	12.1	0.0
61-90	9.6	8.6	0.0	0.0	8.6	9.6	0.0
91-180	72.4	63.7	41.0	70.0	22.7	2.4	0.0
>180	45.5	34.6	7.0	15.0	2.6	5.5	25.0
Total	1121.7	844.8	433.7	382.0	142.0	470.5	269.2

* 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	5.8 %	5.7 %	5.4 %	5.7 %
15-35	5.7 %	5.6 %	5.6 %	5.6 %
36-60	-	5.6 %	5.4 %	5.5 %
61-90	-	6.1 %	5.4 %	5.7 %
91-180	-	6.0 %	5.3 %	5.5 %
>180	5.3 %	5.8 %	5.1 %	5.3 %
Total	5.8 %	5.6 %	5.5 %	5.6 %

*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**	31	110	4669	3968	18	92	3441	2709	27	118	3263	3188
Intragruppo y off-shore***	0	0	1751	1849	0	0	977	1299	0	0	1473	1227
Otros	110	31	1100	1703	92	18	1046	1457	118	27	1023	1344
Total	140	140	7520	7520	110	110	5464	5464	145	145	5760	5760

* 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.