

Fecha de Publicación: 3 de marzo de 2017

Fecha de Información: 01 de marzo de miércoles 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\$1677.9 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	272.4	333.4	158.0	75.0	29.7	51.7	145.7
15-35	610.4	515.1	163.5	130.0	125.1	253.9	226.5
36-60	13.8	13.5	0.0	0.0	3.5	3.8	10.0
61-90	4.4	4.8	0.0	0.0	4.8	4.4	0.0
91-180	34.2	63.7	20.0	25.0	43.7	9.2	0.0
>180	99.6	97.7	12.6	15.0	82.1	81.6	3.0
Total	1034.9	1028.2	354.1	245.0	288.9	404.7	385.2

* 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	5.6 %	5.8 %	5.5 %	5.7 %
15-35	5.6 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %
36-60	5.5 %	6.0 %	5.1 %	5.5 %
61-90	-	5.6 %	5.3 %	5.4 %
91-180	-	5.4 %	5.3 %	5.4 %
>180	5.2 %	5.4 %	5.2 %	5.3 %
Total	5.6 %	5.7 %	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	111	4743	4104	21	93	3561	2868	27	119	3400	3298
Intragrupoy off-shore***	0	0	1839	1873	0	0	1037	1331	0	0	1488	1246
Otros	111	31	1102	1706	93	21	1072	1472	119	27	1031	1376
Total	142	142	7683	7683	114	114	5671	5671	147	147	5920	5920

* 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.