

Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2017

Fecha de Información: 03 de marzo 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\$1417.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.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	216.6	198.0	78.1	38.6	20.4	78.5	99.5
15-35	513.1	384.2	137.2	203.3	78.5	141.2	168.5
36-60	9.7	34.7	25.0	0.0	4.7	4.7	5.0
61-90	31.5	32.6	0.0	0.0	32.6	31.5	0.0
91-180	1.7	9.5	0.0	0.0	9.5	1.7	0.0
>180	191.1	113.9	47.0	15.0	20.9	130.1	46.0
Total	963.7	772.9	287.3	256.9	166.6	387.8	319.0

* 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	5.6 %	5.6 %	5.1 %	5.4 %
15-35	5.4 %	5.6 %	5.3 %	5.4 %
36-60	5.5 %	5.6 %	3.2 %	5.3 %
61-90	-	7.0 %	6.8 %	6.9 %
91-180	-	5.7 %	4.6 %	5.5 %
>180	5.0 %	5.2 %	5.1 %	5.1 %
Total	5.4 %	5.6 %	5.3 %	5.4 %

* 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

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	112	5455	4711	22	98	3869	3165	28	121	3649	3490
Intragrupa y off-shore***	0	0	1842	1974	0	0	1188	1380	0	0	1552	1284
Otros	112	31	1678	2291	98	22	1060	1573	121	28	1060	1487
Total	143	143	8976	8976	120	120	6118	6118	149	149	6261	6261

* 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.