

Fecha de Publicación: 8 de marzo de 2017

Fecha de Información: 06 de marzo 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\$1395.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	201.7	257.2	87.8	53.0	43.4	22.7	126.0
15-35	565.0	431.0	59.4	181.8	255.7	267.2	116.0
36-60	16.1	26.2	0.1	0.0	12.1	2.1	14.0
61-90	17.2	8.1	0.0	0.0	8.1	17.2	0.0
91-180	7.6	35.6	0.1	0.0	35.5	7.6	0.0
>180	61.4	38.8	15.4	5.0	8.4	41.4	15.0
Total	869.1	796.9	162.7	239.8	363.2	358.3	271.0

* 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 %	5.8 %	5.1 %	5.8 %
15-35	5.7 %	5.8 %	5.3 %	5.5 %
36-60	5.5 %	5.6 %	5.1 %	5.6 %
61-90	-	5.6 %	5.2 %	5.3 %
91-180	-	5.5 %	5.2 %	5.4 %
>180	5.1 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %
Total	5.8 %	5.7 %	5.2 %	5.5 %

* 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

Sector	6 al 10 de marzo				13 al 17 de marzo				20 al 24 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	102	4071	3354	28	123	3726	3628	15	72	1933	1787
Intragrupa y off-shore***	0	0	1196	1393	0	0	1632	1324	0	0	946	796
Otros	101	22	1145	1664	123	28	1089	1495	72	15	475	771
Total	124	124	6412	6412	151	151	6447	6447	87	87	3353	3353

* 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.