

Fecha de Publicación: 9 de marzo de 2017

Fecha de Información: 07 de marzo 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\$1612.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	206.7	223.1	83.0	55.4	15.8	27.0	124.3
15-35	613.9	606.5	156.5	195.1	236.1	204.8	214.0
36-60	15.5	28.1	3.3	0.0	9.9	0.5	15.0
61-90	10.7	6.7	0.0	0.0	6.7	10.7	0.0
91-180	23.8	28.3	10.0	20.0	18.3	3.8	0.0
>180	196.7	37.0	0.0	30.0	6.0	135.7	31.0
Total	1067.3	929.6	252.7	300.5	292.6	382.5	384.3

* 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	6.2 %	6.9 %	5.4 %	6.3 %
15-35	5.7 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	5.2 %	5.7 %	5.1 %	5.4 %
61-90	-	6.6 %	5.1 %	5.7 %
91-180	-	5.4 %	5.2 %	5.3 %
>180	5.0 %	5.8 %	5.0 %	5.0 %
Total	5.8 %	6.1 %	5.4 %	5.7 %

*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	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	22	103	6269	5520	28	123	3703	3655	15	72	1979	1820												
Intragrupa y off-shore***	0	0	1213	1433	0	0	1698	1340	0	0	954	829												
Otros	103	22	3189	3719	123	28	1030	1436	72	15	494	777												
Total	125	125	10672	10672	152	152	6431	6431	87	87	3426	3426												

* 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.