

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2017

Fecha de Información: 08 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\$1538.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	205.6	314.3	236.5	108.0	13.8	33.5	64.0
15-35	536.6	463.2	172.0	195.3	141.2	191.3	150.0
36-60	38.9	7.2	0.0	18.3	7.2	20.7	0.0
61-90	60.2	13.6	0.0	55.4	13.6	4.7	0.0
91-180	10.9	10.3	0.0	5.0	10.3	5.9	0.0
>180	73.2	65.7	10.0	0.0	8.7	26.2	47.0
Total	925.3	874.2	418.5	382.0	194.7	282.3	261.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.0 %	6.2 %	5.8 %	6.0 %
15-35	5.8 %	5.7 %	5.6 %	5.7 %
36-60	-	6.0 %	5.2 %	5.4 %
61-90	-	5.7 %	4.6 %	5.4 %
91-180	-	5.8 %	5.1 %	5.5 %
>180	5.0 %	5.2 %	4.7 %	4.9 %
Total	5.7 %	5.8 %	5.5 %	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
Sector Financiero**	22	107	6553	5894	28	127	3772	3728	13	72	2007	1853
Intragruppo y off-shore***	0	0	1462	1583	0	0	1754	1373	0	0	964	829
Otros	107	22	3262	3799	127	28	1037	1461	72	13	516	804
Total	129	129	11276	11276	155	155	6562	6562	85	85	3486	3486

* 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 intragruppo.