

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2017

Fecha de Información: 09 de marzo de jueves 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\$1864.3 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	211.5	387.3	215.5	57.8	70.8	52.7	101.0
15-35	586.4	613.6	243.8	279.0	252.8	190.4	117.0
36-60	8.9	27.0	22.5	0.0	4.5	8.9	0.0
61-90	6.6	22.5	17.4	0.0	5.0	6.6	0.0
91-180	62.1	19.1	0.0	0.0	19.1	62.1	0.0
>180	88.1	49.3	40.0	0.0	9.3	88.1	0.0
Total	963.7	1118.7	539.3	336.8	361.4	408.9	218.0

* 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	6.8 %	6.1 %	3.9 %	5.7 %
15-35	5.9 %	5.9 %	5.6 %	5.8 %
36-60	-	6.0 %	5.0 %	5.5 %
61-90	-	5.6 %	4.9 %	5.2 %
91-180	-	5.4 %	4.5 %	4.7 %
>180	-	5.1 %	4.9 %	5.0 %
Total	6.3 %	5.9 %	5.1 %	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	108	6715	6135	43	125	3848	3911	14	122	2038	1938
Intragrupa y off-shore***	0	0	1513	1583	0	0	1904	1421	0	0	979	843
Otros	108	22	3412	3922	125	43	1014	1433	122	14	582	817
Total	130	130	11640	11640	167	167	6766	6766	136	136	3599	3599

* 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.