

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1054.0 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	122.0	134.1	45.0	20.5	16.1	28.5	73.0
15-35	463.0	422.6	146.4	136.1	153.5	204.2	122.8
36-60	9.0	7.7	0.0	0.0	7.7	9.0	0.0
61-90	11.7	18.0	0.0	10.0	18.0	1.7	0.0
91-180	0.1	21.0	0.0	0.0	21.0	0.1	0.0
>180	11.6	39.1	20.0	0.0	9.1	1.6	10.0
Total	617.3	642.4	211.4	166.6	225.3	245.0	205.8

* 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 %	6.2 %	4.8 %	5.7 %
15-35	6.0 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	-	6.1 %	4.2 %	5.1 %
61-90	-	5.4 %	5.0 %	5.4 %
91-180	-	5.8 %	4.7 %	5.8 %
>180	5.0 %	5.2 %	4.8 %	5.1 %
Total	5.9 %	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**	19	107	6898	6315	44	129	3878	3963	15	125	2123	2011
Intragrupa y off-shore***	0	0	1513	1583	0	0	1941	1435	0	0	986	850
Otros	107	19	3592	4105	129	44	1017	1438	125	15	585	833
Total	126	126	12003	12003	173	173	6836	6836	140	140	3695	3695

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.