

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2017

Fecha de Información: 15 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\$1645.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	241.0	138.2	26.3	192.5	74.9	11.5	37.0
15-35	613.3	481.2	255.0	204.7	129.2	311.6	97.0
36-60	0.2	15.5	0.0	0.0	15.5	0.2	0.0
61-90	47.5	20.5	2.0	42.0	18.5	5.5	0.0
91-180	11.1	109.3	0.0	0.0	99.3	1.1	10.0
>180	81.4	86.0	15.0	15.0	15.0	10.4	56.0
Total	994.4	850.7	298.3	454.2	352.4	340.2	200.0

* 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	6.1 %	6.5 %	6.1 %	6.2 %
15-35	6.0 %	6.3 %	5.7 %	6.0 %
36-60	-	6.3 %	4.7 %	6.3 %
61-90	-	5.5 %	5.4 %	5.4 %
91-180	5.1 %	5.3 %	5.0 %	5.3 %
>180	4.8 %	4.8 %	4.6 %	4.8 %
Total	5.7 %	6.1 %	5.8 %	5.9 %

*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	13 al 17 de marzo				20 al 24 de marzo				27 al 31 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	130	4362	4338	15	130	2299	2223	11	140	2797	2569
Intragrupa y off-shore***	0	0	2115	1686	0	0	1146	947	0	0	821	688
Otros	130	44	1057	1510	130	15	567	840	140	11	917	1279
Total	174	174	7534	7534	145	145	4011	4011	151	151	4536	4536

* 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.