

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2017

Fecha de Información: 16 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\$2134.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	284.4	380.7	204.8	169.5	82.0	20.9	94.0
15-35	710.9	580.7	397.5	290.9	67.3	304.0	116.0
36-60	6.7	18.4	0.0	0.0	18.4	6.7	0.0
61-90	5.7	23.9	0.0	0.0	23.9	5.7	0.0
91-180	8.1	160.2	0.0	0.0	160.2	8.1	0.0
>180	141.9	42.8	0.0	80.0	22.8	41.9	20.0
Total	1157.6	1206.8	602.3	540.4	374.6	387.2	230.0

* 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	5.8 %	5.0 %	5.9 %	5.4 %
15-35	5.6 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %
36-60	-	6.3 %	5.3 %	6.0 %
61-90	-	5.8 %	5.1 %	5.6 %
91-180	-	5.5 %	4.8 %	5.5 %
>180	4.9 %	5.3 %	4.9 %	5.0 %
Total	5.6 %	5.4 %	5.5 %	5.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	45	128	4523	4384	15	130	2359	2337	11	144	2869	2813
Intragruppo y off-shore***	0	0	2115	1808	0	0	1217	960	0	0	956	723
Otros	128	45	1062	1509	130	15	579	858	144	11	1002	1291
Total	173	173	7700	7700	146	146	4155	4155	155	155	4827	4827

* 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.