

Fecha de Publicación: 23 de marzo de 2017

Fecha de Información: 21 de marzo de martes 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\$1969.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.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	297.5	330.9	147.0	79.5	12.0	46.0	172.0
15-35	629.0	491.6	254.3	229.5	125.8	288.0	111.5
36-60	46.5	31.8	0.0	16.5	21.8	20.0	10.0
61-90	9.7	21.7	0.0	0.0	21.7	9.7	0.0
91-180	4.4	169.0	0.0	0.0	169.0	4.4	0.0
>180	198.8	41.8	15.0	130.0	16.8	58.8	10.0
Total	1185.8	1086.8	416.2	455.5	367.1	426.8	303.5

* 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	6.4 %	6.4 %	6.0 %	6.3 %
15-35	5.8 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %
36-60	5.4 %	6.0 %	5.6 %	5.7 %
61-90	-	5.8 %	5.0 %	5.5 %
91-180	-	5.5 %	4.9 %	5.5 %
>180	4.9 %	5.0 %	4.8 %	4.8 %
Total	6.1 %	5.8 %	5.6 %	5.8 %

*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	20 al 24 de marzo				27 al 31 de marzo				3 al 7 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	129	2656	2590	18	200	2970	2996	7	80	2801	2480
Intragrupa y off-shore***	0	0	1290	1067	0	0	1112	745	0	0	1073	1108
Otros	129	20	580	869	200	18	979	1320	80	7	704	990
Total	148	148	4526	4526	217	217	5061	5061	87	87	4578	4578

* 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.