

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2017

Fecha de Información: 27 de marzo de lunes 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\$1283.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	105.3	175.1	115.0	62.0	32.9	16.1	27.2
15-35	392.0	286.5	159.5	142.6	87.0	209.4	40.0
36-60	63.2	39.9	0.0	20.0	29.9	33.2	10.0
61-90	48.0	38.9	0.0	12.0	38.9	36.0	0.0
91-180	106.1	58.6	0.0	50.0	58.6	56.1	0.0
>180	40.0	6.5	0.0	0.0	6.5	40.0	0.0
Total	754.7	605.5	274.5	286.6	253.8	390.9	77.2

* 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	5.9 %	6.1 %	6.1 %	6.1 %
15-35	5.9 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	5.4 %	5.8 %	5.3 %	5.5 %
61-90	-	5.1 %	5.1 %	5.1 %
91-180	-	5.3 %	5.0 %	5.1 %
>180	-	5.7 %	4.8 %	4.9 %
Total	5.8 %	5.8 %	5.4 %	5.6 %

*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	27 al 31 de marzo				3 al 7 de abril				10 al 14 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	311	3396	3411	15	90	2921	2683	41	73	2552	2666
Intragrupa y off-shore***	0	0	1339	920	0	0	1181	1131	0	0	1217	948
Otros	311	18	971	1375	90	15	737	1024	73	41	574	728
Total	330	330	5706	5706	105	105	4838	4838	115	115	4342	4342

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.