

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2017

Fecha de Información: 29 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\$1597.1 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	364.1	204.9	60.9	207.0	13.0	26.1	131.0
15-35	578.8	438.4	168.5	282.2	139.9	166.6	130.0
36-60	44.5	29.3	0.0	10.9	29.3	33.6	0.0
61-90	1.8	33.1	0.0	0.0	33.1	1.8	0.0
91-180	30.5	92.8	0.0	10.0	72.8	0.5	20.0
>180	11.5	58.4	0.0	0.0	48.4	1.5	10.0
Total	1031.2	856.9	229.4	510.1	336.5	230.0	291.0

* 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 %	6.2 %	5.7 %	5.9 %
15-35	5.7 %	5.9 %	5.5 %	5.7 %
36-60	-	6.3 %	5.3 %	5.7 %
61-90	-	5.8 %	4.9 %	5.7 %
91-180	5.2 %	5.3 %	5.1 %	5.2 %
>180	4.7 %	5.0 %	4.7 %	4.9 %
Total	5.7 %	5.8 %	5.5 %	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**	25	318	3653	3495	20	121	3190	2864	45	75	2740	2871
Intragrupa y off-shore***	0	0	1396	1146	0	0	1232	1227	0	0	1289	992
Otros	318	25	972	1380	121	20	756	1088	75	45	601	767
Total	343	343	6021	6021	140	140	5178	5178	121	121	4630	4630

* 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.