

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2017

Fecha de Información: 24 de marzo de viernes 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\$1234.3 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	232.6	251.6	83.0	112.0	71.1	23.1	97.5
15-35	406.0	285.0	137.0	160.8	24.5	121.8	123.5
36-60	1.9	10.5	0.0	0.1	10.5	1.7	0.0
61-90	35.0	62.7	10.0	0.0	52.7	35.0	0.0
91-180	0.1	97.9	0.0	0.0	97.9	0.1	0.0
>180	40.1	41.8	10.0	0.0	21.8	30.1	10.0
Total	715.7	749.6	240.0	272.9	278.6	211.8	231.0

* 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	5.9 %	6.4 %	5.5 %	6.0 %
15-35	5.9 %	6.6 %	5.7 %	6.0 %
36-60	-	6.2 %	5.1 %	6.0 %
61-90	-	5.4 %	5.0 %	5.3 %
91-180	-	5.6 %	-4.8 %	5.6 %
>180	4.9 %	5.0 %	4.9 %	4.9 %
Total	5.9 %	6.1 %	5.5 %	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

Sectores	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**	18	130	2715	2704	17	281	3396	3385	12	89	2898	2567
Intragrupa y off-shore***	0	0	1368	1105	0	0	1304	867	0	0	1101	1122
Otros	130	18	594	868	281	17	992	1440	89	12	715	1025
Total	149	149	4677	4677	298	298	5693	5693	101	101	4714	4714

* 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.