

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2017

Fecha de Información: 30 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\$1258.6 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 | 179.9 | 117.5 | 28.0 | 92.0 | 24.5 | 22.9 | 65.0 |
| 15-35 | 469.6 | 343.7 | 111.9 | 216.3 | 140.0 | 161.6 | 91.8 |
| 36-60 | 14.0 | 10.3 | 0.0 | 10.0 | 10.3 | 4.0 | 0.0 |
| 61-90 | 36.8 | 43.2 | 0.0 | 0.0 | 40.2 | 33.8 | 3.0 |
| 91-180 | 63.8 | 83.2 | 0.0 | 15.0 | 38.2 | 3.8 | 45.0 |
| >180 | 78.5 | 32.9 | 0.0 | 0.0 | 22.9 | 68.5 | 10.0 |
| Total | 842.7 | 630.7 | 139.9 | 333.3 | 276.0 | 294.7 | 214.8 |

* 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 | 5.4 % | 5.8 % | 5.8 % | 5.7 % |
| 15-35 | 5.5 % | 6.0 % | 5.4 % | 5.7 % |
| 36-60 | - | 5.9 % | 5.1 % | 5.4 % |
| 61-90 | 6.7 % | 5.3 % | 4.9 % | 5.2 % |
| 91-180 | 5.1 % | 5.3 % | 4.8 % | 5.1 % |
| >180 | 4.8 % | 4.9 % | 4.8 % | 4.8 % |
| Total | 5.4 % | 5.8 % | 5.3 % | 5.5 % |

* 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 | 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** | 26 | 308 | 3712 | 3523 | 20 | 122 | 3293 | 2921 | 45 | 77 | 2766 | 2905 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1403 | 1192 | 0 | 0 | 1242 | 1273 | 0 | 0 | 1300 | 992 |
| Otros | 308 | 26 | 988 | 1388 | 122 | 20 | 761 | 1103 | 77 | 45 | 605 | 775 |
| Total | 334 | 334 | 6103 | 6103 | 142 | 142 | 5296 | 5296 | 123 | 123 | 4671 | 4671 |

* 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.