

Fecha de Publicación: 5 de abril de 2017

Fecha de Información: 03 de abril 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\$1170.9 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	253.1	181.4	39.5	119.0	24.4	16.6	117.5
15-35	380.4	387.3	218.3	157.2	47.5	101.7	121.5
36-60	17.3	23.5	0.0	13.1	23.5	4.2	0.0
61-90	17.7	30.6	1.3	6.4	18.4	0.4	10.9
91-180	41.7	51.3	12.0	40.0	39.3	1.7	0.0
>180	15.5	36.1	11.2	0.0	9.9	0.5	15.0
Total	725.6	710.2	282.3	335.7	163.0	125.0	264.9

* 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	4.8 %	6.0 %	5.5 %	5.3 %
15-35	5.4 %	6.7 %	5.3 %	5.8 %
36-60	-	5.8 %	4.9 %	5.7 %
61-90	5.1 %	5.6 %	5.4 %	5.4 %
91-180	-	5.1 %	5.1 %	5.1 %
>180	4.8 %	5.0 %	4.6 %	4.9 %
Total	5.1 %	6.1 %	5.3 %	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	3 al 7 de abril												10 al 14 de abril				17 al 21 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V				
Sector Financiero**	22	120	3503	3121	45	78	2843	2977	51	152	3527	2519								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1353	1393	0	0	1300	1012	0	0	1104	1399								
Otros	120	22	785	1127	78	45	630	785	152	51	779	1491								
Total	142	142	5641	5641	124	124	4773	4773	203	203	5410	5410								

* 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.