

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2017

Fecha de Información: 06 de abril 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\$1264.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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 | 236.7 | 110.6 | 54.0 | 171.0 | 13.1 | 22.2 | 43.5 |
| 15-35 | 405.3 | 329.4 | 176.2 | 201.8 | 41.7 | 92.0 | 111.5 |
| 36-60 | 16.0 | 13.6 | 0.0 | 0.0 | 13.6 | 16.0 | 0.0 |
| 61-90 | 41.6 | 90.4 | 1.0 | 10.0 | 64.4 | 6.6 | 25.0 |
| 91-180 | 33.7 | 51.3 | 0.1 | 10.0 | 51.2 | 23.7 | 0.0 |
| >180 | 86.0 | 35.5 | 0.0 | 20.9 | 29.5 | 59.1 | 6.0 |
| Total | 819.3 | 630.8 | 231.3 | 413.6 | 213.5 | 219.7 | 186.0 |

* 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 | 5.2 % | 5.7 % | 5.3 % | 5.4 % |
| 15-35 | 5.2 % | 5.9 % | 5.0 % | 5.3 % |
| 36-60 | - | 5.7 % | 4.9 % | 5.3 % |
| 61-90 | 5.1 % | 6.5 % | 5.0 % | 5.9 % |
| 91-180 | - | 5.3 % | 5.0 % | 5.2 % |
| >180 | 4.5 % | 5.0 % | 4.7 % | 4.8 % |
| Total | 5.1 % | 5.8 % | 5.1 % | 5.3 % |

* 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 | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 27 | 121 | 3703 | 3283 | 46 | 75 | 3074 | 3101 | 48 | 156 | 3711 | 2649 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1477 | 1532 | 0 | 0 | 1337 | 1173 | 0 | 0 | 1202 | 1504 |
| Otros | 121 | 27 | 784 | 1149 | 75 | 46 | 650 | 787 | 156 | 48 | 796 | 1557 |
| Total | 149 | 149 | 5964 | 5964 | 120 | 120 | 5061 | 5061 | 204 | 204 | 5710 | 5710 |

* 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.