

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2017

Fecha de Información: 07 de abril 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\$1265.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	271.2	286.0	122.5	116.6	43.5	34.6	120.0
15-35	295.1	329.9	165.5	121.8	52.2	61.1	112.3
36-60	4.1	17.7	5.0	0.4	12.7	3.7	0.0
61-90	12.1	6.3	0.0	10.0	6.3	2.1	0.0
91-180	67.8	113.7	0.0	0.0	108.7	62.8	5.0
>180	92.9	56.0	0.0	10.0	6.0	32.9	50.0
Total	743.2	809.6	293.0	258.8	229.4	197.2	287.3

* 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	5.5 %	5.2 %	5.0 %	5.2 %
15-35	5.2 %	5.3 %	4.9 %	5.2 %
36-60	-	5.5 %	2.9 %	4.9 %
61-90	-	5.7 %	5.0 %	5.3 %
91-180	5.1 %	5.1 %	5.0 %	5.1 %
>180	4.7 %	5.2 %	4.8 %	4.8 %
Total	5.2 %	5.2 %	4.9 %	5.1 %

*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**	27	123	3703	3283	30	73	3204	3198	72	159	3843	2833								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1477	1532	0	0	1384	1259	0	0	1278	1534								
Otros	123	27	785	1149	73	30	662	792	159	72	823	1577								
Total	150	150	5964	5964	103	103	5250	5250	231	231	5944	5944								

* 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.