

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2017

Fecha de Información: 12 de abril de miércoles 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\$812.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33.8	177.7	163.0	25.5	14.7	8.3	0.0
15-35	241.6	185.5	87.5	158.3	52.0	37.4	46.0
36-60	3.2	17.2	0.0	0.0	17.2	3.2	0.0
61-90	19.0	10.8	0.0	13.4	10.8	5.5	0.0
91-180	0.4	28.5	0.0	0.0	28.5	0.4	0.0
>180	114.5	86.5	0.0	30.0	26.5	24.5	60.0
Total	412.6	506.2	250.5	227.2	149.7	79.4	106.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	6.4 %	5.4 %	6.2 %
15-35	5.6 %	5.6 %	5.0 %	5.3 %
36-60	-	5.7 %	4.7 %	5.5 %
61-90	-	5.5 %	5.1 %	5.3 %
91-180	-	5.6 %	4.6 %	5.6 %
>180	4.8 %	5.2 %	4.8 %	4.9 %
Total	5.1 %	5.8 %	5.0 %	5.4 %

*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	10 al 14 de abril				17 al 21 de abril				24 al 28 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	71	3317	3332	73	159	3955	3234	65	167	3105	2725
Intragruppo y off-shore***	0	0	1496	1345	0	0	1609	1580	0	0	1214	1428
Otros	71	30	666	802	159	73	855	1605	167	65	836	1002
Total	102	102	5479	5479	232	232	6419	6419	232	232	5154	5154

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.