

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2017

Fecha de Información: 17 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\$1293.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	169.1	304.7	149.0	8.0	52.7	58.1	103.0
15-35	423.5	330.6	108.0	143.5	159.6	217.0	63.0
36-60	0.3	17.8	0.0	0.0	17.8	0.3	0.0
61-90	3.4	6.4	0.0	0.0	6.4	3.4	0.0
91-180	72.9	61.7	3.0	0.0	58.7	72.9	0.0
>180	35.2	59.2	13.7	10.0	20.5	0.2	25.0
Total	704.3	780.5	273.7	161.5	315.8	351.8	191.0

* 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	6.0 %	6.4 %	2.4 %	5.5 %
15-35	5.9 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %
36-60	-	5.9 %	4.9 %	5.9 %
61-90	-	6.0 %	4.9 %	5.6 %
91-180	-	5.4 %	4.6 %	5.0 %
>180	5.1 %	5.1 %	4.9 %	5.1 %
Total	5.8 %	5.9 %	5.0 %	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

Sector	17 al 21 de abril				24 al 28 de abril				1 al 5 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	73	162	4050	3425	67	167	3176	2833	6	82	1931	1624
Intragruppo y off-shore***	0	0	1748	1580	0	0	1224	1436	0	0	732	794
Otros	162	73	862	1655	167	67	876	1007	82	6	325	570
Total	235	235	6660	6660	234	234	5276	5276	88	88	2988	2988

* 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.