

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1474.6 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	177.8	168.1	99.7	97.0	28.4	40.8	40.0
15-35	438.7	544.4	320.0	109.2	159.4	264.5	65.0
36-60	2.9	29.5	16.0	0.0	13.5	2.9	0.0
61-90	36.3	17.3	0.0	20.0	17.3	16.3	0.0
91-180	2.6	31.4	0.0	0.0	31.3	2.5	0.1
>180	115.2	35.7	0.0	15.0	15.6	80.1	20.1
Total	773.5	826.3	435.7	241.2	265.4	407.1	125.2

* 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	5.8 %	6.3 %	5.8 %	6.0 %
15-35	5.8 %	5.8 %	5.5 %	5.7 %
36-60	5.9 %	5.7 %	5.4 %	5.6 %
61-90	5.7 %	5.5 %	5.2 %	5.3 %
91-180	5.5 %	5.5 %	4.9 %	5.5 %
>180	4.9 %	5.2 %	4.7 %	4.8 %
Total	5.7 %	5.8 %	5.4 %	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	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**	77	157	4287	3635	69	168	3283	3014	6	83	2076	1842
Intragrupa y off-shore***	0	0	1892	1759	0	0	1305	1447	0	0	805	810
Otros	157	77	872	1657	168	69	936	1063	83	6	387	617
Total	234	234	7051	7051	237	237	5524	5524	90	90	3268	3268

* 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.