

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2017

Fecha de Información: 20 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\$1668.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	194.0	206.9	65.0	68.0	49.9	34.0	92.0
15-35	695.3	706.5	331.5	60.3	177.0	437.1	198.0
36-60	6.7	9.2	0.0	0.0	9.2	6.7	0.0
61-90	16.2	15.3	0.0	0.0	5.3	6.2	10.0
91-180	0.4	7.2	0.0	0.0	7.2	0.4	0.0
>180	58.5	61.8	45.0	45.0	6.8	3.5	10.0
Total	971.2	1007.0	441.5	173.3	255.5	487.9	310.0

* 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	6.1 %	6.7 %	5.2 %	6.2 %
15-35	5.6 %	5.9 %	5.5 %	5.7 %
36-60	-	5.5 %	5.2 %	5.4 %
61-90	5.5 %	5.6 %	5.2 %	5.4 %
91-180	-	5.5 %	4.7 %	5.4 %
>180	4.7 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %
Total	5.7 %	6.0 %	5.5 %	5.7 %

*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	142	4339	3658	72	176	3391	3156	6	84	2147	1922
Intragrupa y off-shore***	0	0	1910	1805	0	0	1342	1469	0	0	815	810
Otros	142	77	877	1663	176	72	978	1087	84	6	389	618
Total	219	219	7126	7126	248	248	5711	5711	90	90	3351	3351

* 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.