

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2017

Fecha de Información: 24 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\$796.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	165.3	233.7	149.4	42.0	21.3	60.3	63.0
15-35	229.2	164.3	86.5	135.1	11.8	28.1	66.0
36-60	10.8	2.6	0.0	0.0	2.6	10.8	0.0
61-90	13.3	29.6	0.0	0.0	29.6	13.3	0.0
91-180	1.0	18.9	0.0	0.0	18.9	1.0	0.0
>180	24.0	32.8	23.5	23.5	9.3	0.5	0.0
Total	443.7	481.8	259.4	200.6	93.4	114.1	129.0

* 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 %	6.1 %	4.0 %	5.5 %
15-35	5.8 %	5.9 %	5.5 %	5.7 %
36-60	-	5.8 %	4.9 %	5.0 %
61-90	-	5.5 %	4.8 %	5.3 %
91-180	-	5.3 %	2.1 %	5.1 %
>180	-	4.8 %	4.9 %	4.9 %
Total	5.9 %	5.8 %	4.8 %	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	24 al 28 de abril				1 al 5 de mayo				8 al 12 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	73	171	3559	3322	6	85	2181	2049	9	97	1954	1757
Intragrupa y off-shore***	0	0	1450	1511	0	0	908	821	0	0	767	735
Otros	171	73	988	1164	85	6	407	626	97	9	530	759
Total	244	244	5997	5997	92	92	3496	3496	106	106	3251	3251

* 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 intragrupo.