

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1229.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 143.7 | 208.1 | 176.5 | 110.0 | 16.6 | 18.7 | 15.0 |
| 15-35 | 247.4 | 279.9 | 200.5 | 170.8 | 12.7 | 9.9 | 66.8 |
| 36-60 | 100.2 | 100.4 | 0.0 | 0.0 | 100.4 | 100.2 | 0.0 |
| 61-90 | 3.3 | 1.7 | 0.0 | 0.0 | 1.7 | 3.3 | 0.0 |
| 91-180 | 71.1 | 51.9 | 0.0 | 0.0 | 51.9 | 71.1 | 0.0 |
| >180 | 90.0 | 93.8 | 10.0 | 10.0 | 3.8 | 0.0 | 80.0 |
| Total | 655.7 | 735.8 | 387.0 | 290.8 | 187.1 | 203.2 | 161.8 |

* 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 % | 5.4 % | 5.1 % | 5.4 % |
| 15-35 | 5.1 % | 5.2 % | 4.8 % | 5.1 % |
| 36-60 | - | 5.0 % | 4.9 % | 5.0 % |
| 61-90 | - | 5.2 % | 4.9 % | 5.0 % |
| 91-180 | - | 5.2 % | 4.9 % | 5.0 % |
| >180 | 4.7 % | 5.0 % | 4.7 % | 4.7 % |
| Total | 5.0 % | 5.2 % | 4.9 % | 5.1 % |

*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

| Sectores | 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 | 74 | 3296 | 3262 | 72 | 159 | 3894 | 2968 | 65 | 168 | 3086 | 2643 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1437 | 1337 | 0 | 0 | 1401 | 1566 | 0 | 0 | 1154 | 1416 |
| Otros | 74 | 30 | 663 | 797 | 159 | 72 | 830 | 1591 | 168 | 65 | 813 | 995 |
| Total | 104 | 104 | 5396 | 5396 | 231 | 231 | 6125 | 6125 | 233 | 233 | 5053 | 5053 |

* 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.