

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2017

Fecha de Información: 10 de abril de lunes¹

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**		Intragruop 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 intragruop		Total
		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
Intragruop 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.