

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2017

Fecha de Información: 25 de abril de martes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1498.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.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	206.7	317.2	172.3	40.6	32.9	54.2	112.0
15-35	533.9	510.0	340.5	205.5	31.5	190.4	138.0
36-60	35.3	2.8	0.0	0.0	2.8	35.3	0.0
61-90	14.0	11.1	0.0	0.0	11.1	14.0	0.0
91-180	2.4	82.0	30.0	0.0	52.0	2.4	0.0
>180	22.8	30.7	0.0	0.0	10.7	2.8	20.0
Total	815.1	953.8	542.8	246.1	141.0	299.0	270.0

* 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 %		6.0 %	4.3 %	5.7 %
15-35	5.9 %		6.3 %	5.6 %	5.9 %
36-60	-		5.9 %	5.3 %	5.3 %
61-90	-		5.9 %	5.1 %	5.4 %
91-180	-		5.2 %	4.7 %	5.2 %
>180	4.7 %		4.9 %	4.4 %	4.8 %
Total	5.9 %		6.0 %	5.3 %	5.8 %

*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	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	3651	3457	7	86	2251	2152	9	97	2014	1823
Intragrupo y off-shore***	0	0	1551	1548	0	0	960	824	0	0	787	735
Otros	171	73	990	1188	86	7	414	649	97	9	540	784
Total	244	244	6192	6192	93	93	3625	3625	106	106	3342	3342

* 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.