

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2017

Fecha de Información: 25 de abril de martes 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\$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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.