

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2017

Fecha de Información: 26 de abril de miércoles 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\$2246.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	972.8	165.8	41.4	31.5	96.0	912.9	28.4
15-35	417.9	525.3	379.8	96.5	14.5	190.4	131.0
36-60	35.2	8.0	0.0	0.0	8.0	35.2	0.0
61-90	45.0	42.4	0.0	10.0	42.4	35.0	0.0
91-180	24.1	28.9	0.0	0.0	13.9	9.1	15.0
>180	84.9	111.4	60.0	10.0	10.4	33.9	41.0
Total	1579.9	881.9	481.2	148.0	185.3	1216.5	215.4

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.3 %	6.0 %	5.5 %	5.6 %
15-35	5.8 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	-	5.9 %	5.4 %	5.5 %
61-90	-	5.2 %	5.1 %	5.2 %
91-180	5.1 %	5.6 %	4.9 %	5.2 %
>180	4.7 %	4.8 %	4.5 %	4.7 %
Total	5.6 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %

*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**	76	175	3726	3506	7	85	3077	2241	29	98	2082	1879
Intragruppo y off-shore***	0	0	1574	1579	0	0	979	824	0	0	808	735
Otros	175	76	991	1206	85	7	481	1471	98	29	566	841
Total	251	251	6291	6291	92	92	4537	4537	127	127	3456	3456

* 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 intragruppo.