

Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2017

Fecha de Información: 27 de abril de jueves 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\$1754.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	364.6	148.9	45.0	198.0	18.8	81.5	85.1
15-35	478.2	833.4	462.8	74.8	103.1	135.9	267.5
36-60	14.9	12.1	10.0	0.0	2.1	14.9	0.0
61-90	100.2	84.7	0.0	0.0	84.7	100.2	0.0
91-180	8.8	11.3	0.4	0.0	10.9	8.8	0.0
>180	48.6	36.8	0.0	4.0	1.8	9.6	35.0
Total	1015.2	1127.2	518.2	276.8	221.4	350.8	387.6

* 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	5.8 %	8.4 %	4.2 %	5.6 %
15-35	4.8 %	6.0 %	5.6 %	5.5 %
36-60	-	5.8 %	5.3 %	5.5 %
61-90	-	5.2 %	5.1 %	5.1 %
91-180	-	5.3 %	5.0 %	5.2 %
>180	4.6 %	5.1 %	4.4 %	4.6 %
Total	5.0 %	6.1 %	5.0 %	5.5 %

*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	167	3911	3563	8	87	3200	2276	29	98	2208	2048
Intragrupo y off-shore***	0	0	1619	1746	0	0	979	855	0	0	848	735
Otros	167	76	995	1215	87	8	490	1538	98	29	575	847
Total	243	243	6525	6525	94	94	4669	4669	127	127	3631	3631

* 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.