

Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2017

Fecha de Información: 28 de abril de viernes 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\$1107.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.2%.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	145.5	81.9	35.5	68.0	18.5	49.6	27.9
15-35	388.6	460.8	280.3	44.0	56.5	220.6	124.0
36-60	18.5	6.9	0.0	0.0	4.2	15.8	2.8
61-90	41.7	39.4	0.0	0.0	29.4	31.7	10.0
91-180	8.3	23.0	0.0	0.0	23.0	8.3	0.0
>180	41.1	40.3	0.0	10.0	16.3	7.1	24.0
Total	643.6	652.4	315.8	122.0	147.9	333.0	188.7

* 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	5.9 %	5.9 %	5.4 %	5.6 %
15-35	5.8 %	5.2 %	5.7 %	5.5 %
36-60	6.0 %	4.1 %	5.4 %	5.2 %
61-90	5.5 %	4.8 %	2.5 %	3.9 %
91-180	-	2.1 %	5.0 %	2.9 %
>180	4.7 %	3.0 %	4.2 %	4.1 %
Total	5.7 %	5.0 %	5.3 %	5.2 %

*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**	75	166	3911	3565	11	82	3305	2343	29	98	2246	2071
Intragruppo y off-shore***	0	0	1619	1746	0	0	1008	923	0	0	855	735
Otros	166	75	996	1215	82	11	504	1550	98	29	587	882
Total	241	241	6526	6526	93	93	4817	4817	127	127	3688	3688

* 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 intragruppo.