

Fecha de Publicación: 4 de mayo de 2017

Fecha de Información: 02 de mayo 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\$1335.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	279.4	246.7	133.5	115.0	29.5	80.7	83.7
15-35	345.5	456.3	237.5	86.0	102.8	143.5	116.0
36-60	105.1	3.2	0.0	21.0	3.2	84.1	0.0
61-90	21.7	10.9	0.0	2.5	10.9	19.2	0.0
91-180	15.2	23.3	10.0	15.0	13.3	0.2	0.0
>180	16.5	11.4	10.0	10.0	1.4	6.5	0.0
Total	783.4	751.9	391.0	249.5	161.2	334.2	199.7

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.5 %	6.1 %	5.1 %	5.6 %
15-35	5.7 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %
36-60	-	6.1 %	5.5 %	5.5 %
61-90	-	5.3 %	4.7 %	4.9 %
91-180	-	5.2 %	5.0 %	5.2 %
>180	-	4.8 %	4.1 %	4.4 %
Total	5.6 %	5.8 %	5.3 %	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	1 al 5 de mayo				8 al 12 de mayo				15 al 19 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	83	3450	2448	30	98	2359	2179	41	150	3048	2514
Intragrupo y off-shore***	0	0	1055	986	0	0	922	777	0	0	1094	1093
Otros	83	12	502	1572	98	30	615	939	150	41	843	1377
Total	95	95	5007	5007	127	127	3895	3895	192	192	4984	4984

* 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.