

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2017

Fecha de Información: 04 de mayo 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\$1582.9 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 | 222.1 | 175.8 | 87.0 | 133.2 | 56.8 | 56.9 | 32.0 |
| 15-35 | 484.4 | 685.6 | 475.2 | 97.5 | 60.6 | 237.0 | 149.8 |
| 36-60 | 9.8 | 11.8 | 10.8 | 0.0 | 0.9 | 9.8 | 0.0 |
| 61-90 | 22.9 | 14.8 | 0.0 | 0.0 | 9.8 | 17.9 | 5.0 |
| 91-180 | 26.0 | 89.4 | 46.0 | 0.0 | 22.4 | 5.0 | 21.0 |
| >180 | 18.7 | 29.5 | 20.0 | 10.0 | 9.5 | 8.7 | 0.0 |
| Total | 783.9 | 1006.8 | 639.0 | 240.7 | 160.0 | 335.3 | 207.8 |

* 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 % | 5.8 % | 5.5 % | 5.6 % |
| 15-35 | 5.8 % | 5.7 % | 5.5 % | 5.6 % |
| 36-60 | - | 6.3 % | 5.3 % | 5.4 % |
| 61-90 | 5.4 % | 5.4 % | 5.0 % | 5.2 % |
| 91-180 | 5.2 % | 5.2 % | 4.8 % | 5.1 % |
| >180 | - | 4.4 % | 4.3 % | 4.3 % |
| Total | 5.7 % | 5.6 % | 5.4 % | 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 | 3701 | 2525 | 42 | 99 | 2558 | 2363 | 43 | 150 | 3179 | 2694 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1095 | 1201 | 0 | 0 | 981 | 827 | 0 | 0 | 1146 | 1105 |
| Otros | 83 | 12 | 497 | 1567 | 99 | 42 | 645 | 994 | 150 | 43 | 893 | 1419 |
| Total | 95 | 95 | 5293 | 5293 | 141 | 141 | 4184 | 4184 | 193 | 193 | 5218 | 5218 |

* 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.