

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2017

Fecha de Información: 15 de mayo de lunes 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\$1134.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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 | 99.6 | 130.2 | 65.8 | 32.5 | 28.4 | 31.1 | 36.0 |
| 15-35 | 623.1 | 337.8 | 55.8 | 221.1 | 101.3 | 221.3 | 180.7 |
| 36-60 | 5.6 | 16.3 | 0.0 | 0.0 | 16.3 | 5.6 | 0.0 |
| 61-90 | 0.8 | 11.2 | 0.0 | 0.0 | 11.2 | 0.8 | 0.0 |
| 91-180 | 26.5 | 100.4 | 0.1 | 0.0 | 75.4 | 1.5 | 25.0 |
| >180 | 12.3 | 12.3 | 0.2 | 0.0 | 12.2 | 12.3 | 0.0 |
| Total | 768.0 | 608.2 | 121.8 | 253.6 | 244.7 | 272.7 | 241.7 |

* 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 | 6.5 % | 7.3 % | 6.1 % | 6.7 % |
| 15-35 | 6.2 % | 6.1 % | 5.8 % | 6.0 % |
| 36-60 | - | 6.4 % | 5.5 % | 6.2 % |
| 61-90 | - | 5.9 % | 5.5 % | 5.9 % |
| 91-180 | 5.4 % | 5.7 % | 5.2 % | 5.6 % |
| >180 | - | 5.0 % | 4.5 % | 4.8 % |
| Total | 6.2 % | 6.3 % | 5.8 % | 6.0 % |

*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 | 15 al 19 de mayo | | | | 22 al 26 de mayo | | | | 29 de may. al 2 de junio | | | |
|----------------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 45 | 151 | 3646 | 3501 | 19 | 148 | 2842 | 3335 | 13 | 98 | 1887 | 2367 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1569 | 1265 | 0 | 0 | 1747 | 797 | 0 | 0 | 1183 | 483 |
| Otros | 151 | 45 | 1023 | 1472 | 147 | 19 | 677 | 1135 | 98 | 13 | 445 | 664 |
| Total | 197 | 197 | 6238 | 6238 | 166 | 166 | 5267 | 5267 | 111 | 111 | 3514 | 3514 |

* 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.