

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2017

Fecha de Información: 16 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\$1304.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	232.1	229.8	43.3	95.9	75.2	25.0	111.3
15-35	541.7	381.3	182.9	238.8	33.9	138.5	164.5
36-60	4.4	66.3	40.2	0.0	23.1	1.4	3.0
61-90	0.1	11.7	0.0	0.0	11.7	0.1	0.0
91-180	22.3	32.8	0.0	0.0	32.8	22.3	0.0
>180	13.7	52.0	30.0	0.0	17.0	8.7	5.0
Total	814.3	773.8	296.4	334.6	193.7	195.9	283.8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.0 %	6.3 %	5.8 %	6.0 %
15-35	6.0 %	6.2 %	5.7 %	5.9 %
36-60	5.4 %	6.1 %	5.2 %	6.1 %
61-90	-	6.1 %	4.9 %	6.0 %
91-180	-	5.4 %	4.8 %	5.2 %
>180	4.4 %	5.1 %	4.5 %	4.9 %
Total	6.0 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %

*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**	47	147	3739	3569	17	194	2934	3452	13	89	1959	2431
Intragruppo y off-shore***	0	0	1576	1319	0	0	1780	839	0	0	1211	483
Otros	147	47	1023	1450	193	17	720	1145	89	13	465	721
Total	194	194	6339	6339	211	211	5435	5435	102	102	3635	3635

* 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.