

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2017

Fecha de Información: 22 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\$1121.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.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	178.3	146.7	18.0	46.0	79.7	83.3	49.0
15-35	315.1	491.6	330.5	55.7	48.1	146.4	113.0
36-60	14.1	31.8	10.0	0.0	21.8	14.1	0.0
61-90	11.6	3.4	0.0	0.0	3.4	11.6	0.0
91-180	35.2	39.8	0.0	0.0	39.8	35.2	0.0
>180	6.8	14.2	0.0	0.0	9.2	1.8	5.0
Total	561.1	727.4	358.5	101.7	201.9	292.4	167.0

* 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	6.5 %	6.6 %	6.1 %	6.4 %
15-35	6.0 %	6.6 %	6.1 %	6.3 %
36-60	-	6.6 %	5.9 %	6.4 %
61-90	-	6.3 %	5.6 %	5.7 %
91-180	-	5.7 %	5.4 %	5.5 %
>180	5.2 %	5.3 %	4.6 %	5.2 %
Total	6.1 %	6.5 %	6.0 %	6.3 %

* 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	22 al 26 de mayo				29 de may. al 2 de junio				5 al 9 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	188	3471	3804	13	91	2134	2558	15	99	2750	2661
Intragruppo y off-shore***	0	0	1925	1171	0	0	1277	503	0	0	1172	786
Otros	188	16	801	1221	91	13	507	856	99	15	479	954
Total	204	204	6197	6197	104	104	3917	3917	115	115	4400	4400

* 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.