

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2017

Fecha de Información: 25 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\$1898.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.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	333.3	281.4	128.5	208.0	61.9	34.3	91.0
15-35	550.1	727.5	594.5	267.0	15.0	165.1	118.0
36-60	1.2	1.7	0.0	0.0	1.7	1.2	0.0
61-90	17.7	29.2	20.0	0.0	4.2	12.7	5.0
91-180	148.4	45.7	0.0	117.0	17.7	3.4	28.0
>180	0.5	4.3	0.0	0.0	4.3	0.5	0.0
Total	1051.1	1089.8	743.0	592.0	104.8	217.1	242.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.3 %	6.5 %	6.3 %	6.6 %
15-35	6.5 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	6.9 %	5.8 %	6.4 %
61-90	5.9 %	6.1 %	5.9 %	6.0 %
91-180	5.5 %	5.8 %	5.4 %	5.4 %
>180	-	5.8 %	3.8 %	5.6 %
Total	6.7 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {360 / \text{Plazo}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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**	17	190	3728	3901	16	92	2527	2937	16	100	3121	3000
Intragruppo y off-shore***	0	0	1999	1404	0	0	1376	633	0	0	1260	870
Otros	190	17	817	1240	92	16	562	896	100	16	596	1107
Total	206	206	6545	6545	109	109	4466	4466	117	117	4977	4977

* 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.