

Fecha de Publicación: 8 de junio de 2017

Fecha de Información: 06 de junio 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\$1412.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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 | 313.7 | 224.3 | 86.0 | 155.0 | 3.3 | 23.7 | 135.0 |
| 15-35 | 443.3 | 623.3 | 346.5 | 82.5 | 81.4 | 165.5 | 195.4 |
| 36-60 | 60.1 | 18.4 | 0.0 | 40.0 | 3.4 | 5.1 | 15.0 |
| 61-90 | 1.6 | 1.6 | 0.0 | 0.0 | 1.6 | 1.6 | 0.0 |
| 91-180 | 24.7 | 30.4 | 0.0 | 16.0 | 22.4 | 0.7 | 8.0 |
| >180 | 5.8 | 18.4 | 0.0 | 0.0 | 18.4 | 5.8 | 0.0 |
| Total | 849.3 | 916.4 | 432.5 | 293.5 | 130.6 | 202.4 | 353.4 |

* 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 | 6.0 % | 6.0 % | 6.1 % | 6.1 % |
| 15-35 | 5.9 % | 6.0 % | 5.8 % | 5.9 % |
| 36-60 | 5.8 % | 6.1 % | 5.8 % | 5.8 % |
| 61-90 | - | 5.7 % | 5.7 % | 5.7 % |
| 91-180 | 5.5 % | 5.3 % | 5.5 % | 5.4 % |
| >180 | - | 4.8 % | 4.1 % | 4.6 % |
| Total | 5.9 % | 5.9 % | 5.9 % | 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 | 5 al 9 de junio | | | | 12 al 16 de junio | | | | 19 al 23 de junio | | | |
|----------------------------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 20 | 116 | 4077 | 3894 | 22 | 116 | 3491 | 3421 | 23 | 90 | 2281 | 2538 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1762 | 1373 | 0 | 0 | 2020 | 1542 | 0 | 0 | 1249 | 658 |
| Otros | 116 | 20 | 703 | 1275 | 116 | 22 | 608 | 1156 | 90 | 23 | 601 | 935 |
| Total | 136 | 136 | 6542 | 6542 | 137 | 137 | 6119 | 6119 | 113 | 113 | 4131 | 4131 |

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