

Fecha de Publicación: 9 de mayo de 2017

Fecha de Información: 05 de mayo de viernes 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\$1535.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.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	328.1	310.6	148.3	169.4	31.8	28.3	130.5
15-35	529.6	471.8	227.3	195.0	31.3	121.4	213.3
36-60	11.0	9.2	1.4	0.0	7.8	11.0	0.0
61-90	9.8	32.6	23.1	0.0	9.6	9.8	0.0
91-180	99.1	68.8	30.0	62.7	28.8	26.5	10.0
>180	7.4	10.7	4.5	0.0	6.2	7.4	0.0
Total	985.0	903.6	434.5	427.0	115.4	204.3	353.7

* 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	6.0 %	6.4 %	5.4 %	5.9 %
15-35	5.8 %	6.4 %	5.7 %	5.9 %
36-60	-	5.8 %	5.3 %	5.5 %
61-90	-	5.5 %	5.2 %	5.4 %
91-180	5.1 %	5.0 %	4.8 %	5.0 %
>180	-	4.8 %	4.1 %	4.5 %
Total	5.9 %	6.2 %	5.5 %	5.8 %

*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	1 al 5 de mayo				8 al 12 de mayo				15 al 19 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	81	2901	2526	52	108	2797	2580	43	152	3257	2778
Intragrupo y off-shore***	0	0	1095	1201	0	0	1093	964	0	0	1182	1137
Otros	81	11	498	767	108	52	667	1013	152	43	894	1417
Total	92	92	4494	4494	160	160	4557	4557	195	195	5332	5332

* 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.