

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2017

Fecha de Información: 09 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\$1042.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	192.6	284.9	150.5	24.0	65.4	99.6	69.0
15-35	327.3	339.1	162.7	133.5	26.4	43.8	150.0
36-60	1.3	9.9	5.0	0.1	4.9	1.1	0.0
61-90	5.3	6.0	0.0	2.9	6.0	2.4	0.0
91-180	32.3	50.1	13.0	0.0	22.1	17.3	15.0
>180	11.0	26.5	0.0	0.0	16.5	1.0	10.0
Total	569.8	716.5	331.2	160.5	141.3	165.2	244.0

* 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	6.0 %	5.9 %	5.6 %	5.8 %
15-35	5.5 %	5.9 %	5.8 %	5.7 %
36-60	-	6.5 %	4.5 %	6.1 %
61-90	-	5.8 %	5.0 %	5.5 %
91-180	5.1 %	5.4 %	4.9 %	5.2 %
>180	4.4 %	4.8 %	4.2 %	4.6 %
Total	5.6 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %

*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	8 al 12 de mayo				15 al 19 de mayo				22 al 26 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	110	2892	2767	44	152	3382	3008	24	142	2441	2912
Intragruppo y off-shore***	0	0	1235	1003	0	0	1291	1157	0	0	1597	695
Otros	110	54	686	1043	152	44	948	1455	142	24	607	1038
Total	164	164	4814	4814	196	196	5621	5621	166	166	4645	4645

* 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.