

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2017

Fecha de Información: 10 de mayo de miércoles¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1150.8 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	261.8	209.5	40.3	112.3	51.2	31.5	118.0
15-35	498.1	507.7	219.1	145.0	22.1	86.6	266.5
36-60	0.5	3.0	0.0	0.0	3.0	0.5	0.0
61-90	3.4	3.7	0.0	0.0	3.7	3.4	0.0
91-180	10.5	16.8	0.0	10.0	16.8	0.5	0.0
>180	16.1	16.5	0.0	0.0	4.5	4.1	12.0
Total	790.3	757.0	259.4	267.3	101.2	126.6	396.5

* 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	5.8 %		6.3 %	6.0 %	6.0 %
15-35	5.8 %		6.0 %	5.8 %	5.9 %
36-60	-		7.8 %	5.2 %	7.5 %
61-90	-		5.8 %	5.3 %	5.5 %
91-180	-		5.2 %	5.3 %	5.2 %
>180	4.5 %		4.9 %	4.4 %	4.6 %
Total	5.7 %		6.1 %	5.8 %	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	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	114	2961	2798	44	153	3484	3093	24	144	2547	3088
Intragrupo y off-shore***	0	0	1240	1060	0	0	1296	1206	0	0	1679	701
Otros	114	54	706	1049	153	44	976	1457	143	24	619	1056
Total	168	168	4907	4907	196	196	5756	5756	168	168	4845	4845

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