

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2017

Fecha de Información: 11 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\$981.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	147.8	106.8	50.3	90.0	32.5	33.8	24.0
15-35	298.2	343.3	257.0	123.8	59.9	148.0	26.5
36-60	6.3	9.0	0.0	0.0	9.0	6.3	0.0
61-90	11.6	14.5	0.0	0.0	4.5	1.6	10.0
91-180	15.1	13.8	0.0	15.0	13.8	0.1	0.0
>180	9.7	66.3	60.0	9.7	6.3	0.0	0.0
Total	488.7	553.7	367.3	238.5	125.9	189.7	60.5

* 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	6.0 %	6.1 %	5.3 %	5.8 %
15-35	6.1 %	6.9 %	5.8 %	6.3 %
36-60	-	5.9 %	5.4 %	5.7 %
61-90	5.5 %	5.7 %	5.4 %	5.6 %
91-180	-	5.4 %	5.4 %	5.4 %
>180	-	4.9 %	4.5 %	4.8 %
Total	5.9 %	6.3 %	5.7 %	6.0 %

*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	115	3038	2795	47	157	3504	3138	24	143	2594	3157
Intragrupo y off-shore***	0	0	1240	1148	0	0	1321	1208	0	0	1705	702
Otros	115	54	703	1038	157	47	987	1465	143	24	649	1089
Total	169	169	4981	4981	204	204	5811	5811	167	167	4948	4948

* 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.