

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2017

Fecha de Información: 15 de mayo de lunes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1134.5 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	99.6	130.2	65.8	32.5	28.4	31.1	36.0
15-35	623.1	337.8	55.8	221.1	101.3	221.3	180.7
36-60	5.6	16.3	0.0	0.0	16.3	5.6	0.0
61-90	0.8	11.2	0.0	0.0	11.2	0.8	0.0
91-180	26.5	100.4	0.1	0.0	75.4	1.5	25.0
>180	12.3	12.3	0.2	0.0	12.2	12.3	0.0
Total	768.0	608.2	121.8	253.6	244.7	272.7	241.7

* 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	
3-14	6.5 %	7.3 %	6.1 %	6.7 %
15-35	6.2 %	6.1 %	5.8 %	6.0 %
36-60	-	6.4 %	5.5 %	6.2 %
61-90	-	5.9 %	5.5 %	5.9 %
91-180	5.4 %	5.7 %	5.2 %	5.6 %
>180	-	5.0 %	4.5 %	4.8 %
Total	6.2 %	6.3 %	5.8 %	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	15 al 19 de mayo				22 al 26 de mayo				29 de may. al 2 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	151	3646	3501	19	148	2842	3335	13	98	1887	2367
Intragrupo y off-shore***	0	0	1569	1265	0	0	1747	797	0	0	1183	483
Otros	151	45	1023	1472	147	19	677	1135	98	13	445	664
Total	197	197	6238	6238	166	166	5267	5267	111	111	3514	3514

* 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.