

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2017

Fecha de Información: 23 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\$996.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.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	170.3	165.0	38.0	41.5	106.0	107.8	21.0
15-35	417.0	279.5	125.5	137.5	12.0	137.5	142.0
36-60	29.4	18.6	0.0	0.0	3.6	14.4	15.0
61-90	5.6	2.4	0.0	0.0	2.4	5.6	0.0
91-180	1.8	12.1	0.7	0.0	11.4	1.8	0.0
>180	58.1	68.8	10.0	0.0	4.8	4.1	54.0
Total	682.2	546.5	174.2	179.0	140.3	271.2	232.0

* 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	6.9 %	7.1 %	6.4 %	6.8 %
15-35	6.7 %	7.0 %	6.3 %	6.6 %
36-60	5.9 %	6.7 %	5.7 %	5.9 %
61-90	-	6.2 %	5.1 %	5.4 %
91-180	-	5.6 %	5.2 %	5.6 %
>180	4.9 %	5.1 %	4.8 %	4.9 %
Total	6.2 %	6.9 %	6.3 %	6.5 %

*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	22 al 26 de mayo				29 de may. al 2 de junio				5 al 9 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	192	3523	3830	13	91	2156	2623	16	100	2938	2774
Intragruppo y off-shore***	0	0	1949	1208	0	0	1291	503	0	0	1174	819
Otros	192	17	802	1236	91	13	542	863	100	16	545	1063
Total	209	209	6274	6274	104	104	3989	3989	117	117	4656	4656

* 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 intragruppo.