Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2017

Fecha de Información: 12 de mayo de viernes [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$1544.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.[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	291.6	414.3	224.5	120.3	40.7	22.3	149.1
15-35	543.8	409.5	248.0	295.8	31.6	118.2	129.9
36-60	2.7	11.0	0.0	0.0	11.0	2.7	0.0
61-90	38.9	19.3	5.0	0.2	14.3	38.7	0.0
91-180	26.5	35.9	0.0	0.0	16.8	7.4	19.1
>180	22.3	46.6	0.0	0.0	26.6	2.3	20.0
Total	**925.8**	**936.6**	**477.5**	**416.2**	**141.1**	**191.6**	**318.0**

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.1 %	7.9 %	7.1 %	7.3 %
15-35	6.0 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
36-60	6.0 %	6.1 %	5.6 %	6.0 %
61-90	-	5.9 %	5.1 %	5.3 %
91-180	5.4 %	5.4 %	5.1 %	5.4 %
>180	4.6 %	5.3 %	4.6 %	5.0 %
Total	5.9 %	6.9 %	6.2 %	6.4 %

*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	113	3039	2795	47	158	3617	3410	20	145	2772	3295
Intragrupo y off-shore***	0	0	1240	1148	0	0	1508	1258	0	0	1742	772
Otros	113	54	703	1039	158	47	1012	1469	145	20	659	1107
Total	**167**	**167**	**4982**	**4982**	**205**	**205**	**6137**	**6137**	**165**	**165**	**5174**	**5174**

* 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.