Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2017

Fecha de Información: 17 de mayo de miércoles [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$1410.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.[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	180.8	317.7	204.1	60.0	20.6	27.8	93.0
15-35	632.4	378.6	111.0	235.8	107.6	236.6	160.0
36-60	4.4	6.0	0.0	0.0	6.0	4.4	0.0
61-90	4.8	11.3	2.2	0.0	9.1	4.8	0.0
91-180	18.4	51.7	23.0	0.0	18.7	8.4	10.0
>180	25.0	57.7	20.0	0.0	22.7	10.0	15.0
Total	**865.8**	**823.0**	**360.3**	**295.8**	**184.8**	**292.0**	**278.0**

* 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	6.2 %	5.6 %	5.1 %	5.7 %
15-35	6.1 %	5.7 %	5.6 %	5.7 %
36-60	-	6.5 %	5.4 %	6.0 %
61-90	-	5.9 %	4.9 %	5.6 %
91-180	5.4 %	5.6 %	4.8 %	5.4 %
>180	5.0 %	4.9 %	4.2 %	4.8 %
Total	6.1 %	5.6 %	5.5 %	5.7 %

*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**	47	147	3787	3741	17	194	3066	3590	13	90	1991	2488
Intragrupo y off-shore***	0	0	1730	1339	0	0	1815	879	0	0	1238	483
Otros	147	47	1022	1458	194	17	751	1164	90	13	474	733
Total	**194**	**194**	**6539**	**6539**	**211**	**211**	**5632**	**5632**	**103**	**103**	**3704**	**3704**

* 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.