Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2017

Fecha de Información: 19 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$1026.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.[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	231.4	101.7	51.6	81.4	25.1	125.0	25.1
15-35	426.3	528.8	170.5	53.9	58.3	72.3	300.0
36-60	1.4	11.1	0.7	1.0	10.4	0.4	0.0
61-90	0.0	12.3	0.0	0.0	12.3	0.0	0.0
91-180	1.8	14.7	0.0	0.0	14.7	1.8	0.0
>180	16.1	19.4	0.0	0.0	6.3	3.0	13.1
Total	**677.1**	**688.1**	**222.8**	**136.3**	**127.1**	**202.5**	**338.2**

* 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	6.4 %	6.9 %	5.8 %	6.2 %
15-35	6.2 %	6.5 %	6.1 %	6.3 %
36-60	-	6.4 %	5.7 %	6.3 %
61-90	-	6.2 %	-	6.2 %
91-180	-	6.2 %	5.4 %	6.1 %
>180	5.1 %	4.9 %	4.4 %	5.0 %
Total	6.2 %	6.6 %	5.9 %	6.2 %

*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	145	3835	3776	18	192	3405	3774	13	91	2124	2529
Intragrupo y off-shore***	0	0	1755	1394	0	0	1919	1135	0	0	1265	503
Otros	145	47	1032	1452	192	18	806	1221	91	13	489	846
Total	**192**	**192**	**6622**	**6622**	**210**	**210**	**6130**	**6130**	**104**	**104**	**3878**	**3878**

* 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.