Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2017

Fecha de Información: 24 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$1529.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.[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	365.3	250.9	40.0	159.0	19.4	14.8	191.5
15-35	493.3	457.8	196.5	130.0	192.8	294.8	68.5
36-60	44.8	2.5	0.0	0.0	1.5	43.8	1.0
61-90	73.8	25.5	20.0	0.0	5.5	73.8	0.0
91-180	16.7	36.2	5.0	0.0	21.2	6.7	10.0
>180	21.6	17.1	10.0	15.0	2.1	1.6	5.0
Total	**1015.5**	**790.0**	**271.5**	**304.0**	**242.5**	**435.5**	**276.0**

* 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	6.8 %	6.9 %	6.5 %	6.8 %
15-35	6.8 %	7.1 %	6.6 %	6.8 %
36-60	6.1 %	8.0 %	6.0 %	6.1 %
61-90	-	6.1 %	5.6 %	5.7 %
91-180	5.6 %	5.5 %	5.4 %	5.6 %
>180	5.2 %	4.7 %	5.1 %	5.1 %
Total	6.8 %	6.9 %	6.4 %	6.6 %

*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	189	3592	3870	13	92	2384	2789	16	101	3056	2874
Intragrupo y off-shore***	0	0	1969	1260	0	0	1311	590	0	0	1202	839
Otros	189	17	817	1248	92	13	552	868	101	16	547	1092
Total	**206**	**206**	**6378**	**6378**	**105**	**105**	**4247**	**4247**	**117**	**117**	**4805**	**4805**

* 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.