Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2017

Fecha de Información: 26 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$1166.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.[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	318.8	171.7	99.0	228.0	23.4	41.5	49.3
15-35	330.8	422.9	228.5	40.0	28.9	125.3	165.5
36-60	1.3	4.7	1.0	0.0	3.7	1.3	0.0
61-90	4.6	16.1	0.0	0.0	16.1	4.6	0.0
91-180	47.3	42.8	0.0	0.0	22.8	27.3	20.0
>180	5.0	35.7	10.0	3.0	25.7	2.0	0.0
Total	**707.7**	**693.8**	**338.5**	**271.0**	**120.5**	**201.9**	**234.8**

* 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	6.7 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %
15-35	6.5 %	6.6 %	6.3 %	6.5 %
36-60	-	6.3 %	5.8 %	6.2 %
61-90	-	6.3 %	6.0 %	6.3 %
91-180	5.7 %	5.7 %	5.4 %	5.6 %
>180	-	4.9 %	2.8 %	4.6 %
Total	6.5 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %

*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**	16	187	3728	3901	28	83	2780	3017	17	99	3182	3105
Intragrupo y off-shore***	0	0	1999	1404	0	0	1398	830	0	0	1337	901
Otros	187	16	818	1240	83	28	588	919	99	17	607	1121
Total	**204**	**204**	**6545**	**6545**	**111**	**111**	**4766**	**4766**	**116**	**116**	**5126**	**5126**

* 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.