

Fecha de Publicación: 9 de junio de 2017

Fecha de Información: 07 de junio 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\$1638.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	434.0	289.9	119.5	220.6	75.9	118.9	94.5
15-35	316.9	632.2	502.6	123.0	29.6	93.9	100.0
36-60	2.4	5.5	0.0	0.0	5.5	2.4	0.0
61-90	11.6	19.5	0.0	0.0	19.5	11.6	0.0
91-180	46.1	21.7	1.2	45.6	20.5	0.5	0.0
>180	31.8	40.8	10.0	0.0	10.8	11.8	20.0
Total	842.9	1009.7	633.2	389.2	162.0	239.2	214.5

* 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	6.0 %	6.1 %	5.8 %	5.9 %
15-35	6.0 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
36-60	-	6.5 %	5.4 %	6.1 %
61-90	-	5.8 %	5.5 %	5.7 %
91-180	-	5.6 %	5.4 %	5.4 %
>180	4.5 %	4.8 %	4.6 %	4.6 %
Total	5.8 %	6.0 %	5.7 %	5.9 %

*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	5 al 9 de junio				12 al 16 de junio				19 al 23 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	111	4259	3966	22	116	3728	3593	23	90	2299	2621
Intragrupo y off-shore***	0	0	1833	1547	0	0	2040	1589	0	0	1295	658
Otros	111	20	704	1283	116	22	680	1266	90	23	623	938
Total	131	131	6795	6795	139	139	6447	6447	112	112	4217	4217

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^{\frac{1}{(360/\text{Plazo})}} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.