

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2017

Fecha de Información: 09 de junio 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\$1396.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	309.5	164.9	93.3	223.4	33.6	48.1	38.0
15-35	340.0	492.4	299.7	56.0	7.8	99.0	185.0
36-60	0.7	5.8	2.0	0.0	3.8	0.7	0.0
61-90	55.2	37.8	5.0	0.0	2.8	25.2	30.0
91-180	90.1	92.2	20.0	1.0	62.2	79.0	10.0
>180	51.7	38.9	15.0	10.0	3.9	21.7	20.0
Total	847.2	832.0	434.9	290.4	114.1	273.8	283.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.8 %	6.6 %	5.8 %	6.1 %
15-35	5.9 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
36-60	-	6.0 %	5.3 %	5.9 %
61-90	5.5 %	5.6 %	5.5 %	5.5 %
91-180	5.2 %	5.3 %	5.2 %	5.2 %
>180	4.6 %	4.7 %	4.7 %	4.7 %
Total	5.8 %	6.0 %	5.6 %	5.8 %

*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	112	4331	3981	23	114	4098	3847	23	90	2428	2757
Intragruppo y off-shore***	0	0	1849	1614	0	0	2181	1836	0	0	1365	698
Otros	112	20	702	1287	114	23	714	1310	90	23	642	980
Total	132	132	6883	6883	137	137	6993	6993	112	112	4436	4436

* 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 intragruppo.