

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2017

Fecha de Información: 12 de junio de lunes 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\$1378.8 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	252.8	167.9	108.1	175.0	2.8	20.8	57.0
15-35	471.4	531.0	331.3	80.3	67.8	259.1	132.0
36-60	5.9	7.0	0.0	0.0	7.0	5.9	0.0
61-90	8.6	1.1	0.0	0.0	1.1	8.6	0.0
91-180	9.2	15.4	0.0	1.0	15.4	8.2	0.0
>180	66.4	31.0	0.0	60.0	31.0	6.4	0.0
Total	814.4	753.4	439.4	316.3	125.1	309.1	189.0

* 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	6.2 %	6.2 %	6.7 %	6.4 %
15-35	5.9 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
36-60	-	5.9 %	4.5 %	5.3 %
61-90	-	5.9 %	5.0 %	5.1 %
91-180	-	5.5 %	5.0 %	5.3 %
>180	-	5.2 %	4.5 %	4.7 %
Total	6.0 %	6.0 %	5.8 %	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	12 al 16 de junio				19 al 23 de junio				26 al 30 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	104	4319	3972	24	93	2457	2806	15	106	2848	3146
Intragrupo y off-shore***	0	0	2259	2011	0	0	1395	698	0	0	1450	991
Otros	104	23	725	1319	93	24	641	989	106	15	753	915
Total	127	127	7303	7303	118	118	4493	4493	121	121	5051	5051

* 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.