

Fecha de Publicación: 15 de junio de 2017

Fecha de Información: 13 de junio de martes 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\$1619.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	286.2	238.0	137.8	174.5	11.2	22.7	89.0
15-35	681.9	576.8	191.5	121.0	143.3	318.9	242.0
36-60	37.7	18.7	0.0	20.5	13.7	12.2	5.0
61-90	1.5	17.6	0.0	0.0	17.6	1.5	0.0
91-180	86.0	9.6	0.0	55.3	9.6	30.7	0.0
>180	0.4	0.8	0.0	0.0	0.8	0.4	0.0
Total	1093.6	861.6	329.3	371.2	196.3	386.4	336.0

* 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 %	6.0 %	5.9 %	5.9 %
15-35	5.6 %	5.8 %	5.7 %	5.7 %
36-60	5.4 %	5.8 %	5.4 %	5.5 %
61-90	-	5.8 %	5.2 %	5.8 %
91-180	-	5.5 %	5.1 %	5.1 %
>180	-	5.2 %	4.7 %	5.0 %
Total	5.7 %	5.9 %	5.6 %	5.7 %

*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	108	4493	4100	25	93	2522	2911	15	106	3024	3278
Intragruppo y off-shore***	0	0	2352	2139	0	0	1440	698	0	0	1500	1082
Otros	108	23	721	1326	93	25	652	1004	106	15	771	934
Total	130	130	7566	7566	118	118	4614	4614	121	121	5295	5295

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