

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2017

Fecha de Información: 14 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\$1482.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	276.1	168.7	67.5	166.3	30.2	38.8	71.0
15-35	612.7	365.7	202.3	187.0	48.4	310.7	115.0
36-60	0.8	2.9	0.5	0.0	2.3	0.8	0.0
61-90	1.0	13.0	0.0	0.0	13.0	1.0	0.0
91-180	43.3	120.0	70.0	30.0	40.0	3.3	10.0
>180	52.5	47.1	0.5	0.0	21.7	27.5	25.0
Total	986.4	717.4	340.8	383.2	155.7	382.2	221.0

* 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	5.7 %	6.1 %	5.9 %	5.9 %
15-35	5.6 %	5.6 %	5.6 %	5.6 %
36-60	-	5.9 %	5.2 %	5.7 %
61-90	-	5.5 %	4.8 %	5.5 %
91-180	5.0 %	5.5 %	5.0 %	5.3 %
>180	4.6 %	4.9 %	4.2 %	4.6 %
Total	5.5 %	5.6 %	5.6 %	5.6 %

*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	115	4665	4168	28	88	2584	2956	15	103	3078	3317
Intragruppo y off-shore***	0	0	2404	2254	0	0	1456	744	0	0	1500	1087
Otros	115	23	679	1327	88	28	681	1020	103	15	796	969
Total	138	138	7749	7749	116	116	4721	4721	118	118	5373	5373

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