

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2017

Fecha de Información: 15 de junio de jueves¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1331.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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	291.7	203.1	49.7	135.0	38.4	41.6	115.1
15-35	275.1	404.5	323.9	108.5	23.6	109.6	57.0
36-60	15.3	3.8	0.0	0.0	3.8	15.3	0.0
61-90	8.4	37.1	30.0	0.0	7.1	8.4	0.0
91-180	63.8	44.1	23.0	0.9	11.1	52.9	10.0
>180	76.2	115.8	40.0	42.0	50.8	9.2	25.0
Total	730.4	808.5	466.6	286.4	134.8	236.9	207.1

* 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	5.6 %		5.8 %	5.5 %	5.6 %
15-35	5.5 %		5.6 %	5.5 %	5.5 %
36-60	-		5.6 %	5.2 %	5.2 %
61-90	-		5.3 %	5.0 %	5.2 %
91-180	4.9 %		4.9 %	4.8 %	4.9 %
>180	4.5 %		4.5 %	4.4 %	4.4 %
Total	-		5.4 %	5.2 %	5.3 %

*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	114	4785	4205	30	91	2666	3044	26	100	3168	3419
Intragrupo y off-shore***	0	0	2438	2375	0	0	1457	744	0	0	1547	1101
Otros	114	23	684	1326	91	30	706	1040	100	26	807	983
Total	137	137	7907	7907	121	121	4828	4828	126	126	5523	5503

* 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.