

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2017

Fecha de Información: 16 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\$1376.3 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	200.2	139.2	70.0	149.3	41.2	22.9	28.0
15-35	385.1	565.8	442.8	116.9	28.1	173.2	95.0
36-60	10.9	7.0	0.0	0.0	7.0	10.9	0.0
61-90	8.3	21.8	0.0	0.0	21.8	8.3	0.0
91-180	42.3	41.8	0.0	0.0	31.8	32.3	10.0
>180	72.7	44.4	10.0	35.0	4.1	7.5	30.3
Total	719.5	820.1	522.8	301.2	134.0	255.1	163.3

* 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	5.5 %	5.8 %	5.2 %	5.4 %
15-35	5.4 %	5.4 %	5.4 %	5.4 %
36-60	-	5.3 %	5.1 %	5.2 %
61-90	-	5.2 %	4.8 %	5.1 %
91-180	4.9 %	5.0 %	4.8 %	4.9 %
>180	4.6 %	4.5 %	4.3 %	4.5 %
Total	5.2 %	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	113	4797	4211	30	91	2832	3117	26	101	3247	3534
Intragrupo y off-shore***	0	0	2442	2385	0	0	1500	879	0	0	1584	1135
Otros	113	23	685	1327	91	30	720	1057	101	26	853	995
Total	135	135	7923	7923	122	122	5053	5053	127	127	5684	5664

* 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 intragrupo.