

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2017

Fecha de Información: 20 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\$2244.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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	310.8	197.7	146.9	174.8	7.7	93.0	43.0
15-35	609.6	1070.3	784.8	100.4	74.6	298.1	211.0
36-60	35.6	10.0	0.0	2.0	10.0	33.6	0.0
61-90	42.3	3.2	0.0	7.5	3.2	34.7	0.0
91-180	96.4	90.7	0.0	0.0	90.7	96.4	0.0
>180	26.4	5.1	0.0	2.7	5.1	23.7	0.0
Total	1121.1	1377.1	931.7	287.4	191.4	579.6	254.0

* 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	5.9 %	6.0 %	5.3 %	5.6 %
15-35	5.9 %	5.9 %	5.5 %	5.8 %
36-60	-	5.6 %	5.0 %	5.1 %
61-90	-	5.6 %	4.8 %	4.9 %
91-180	-	4.8 %	4.6 %	4.7 %
>180	-	5.1 %	3.9 %	4.1 %
Total	5.9 %	5.8 %	5.2 %	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	19 al 23 de junio				26 al 30 de junio				3 al 7 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	90	3047	3197	26	100	3341	3657	4	66	1510	1763
Intragrupo y off-shore***	0	0	1549	1053	0	0	1681	1135	0	0	1001	476
Otros	90	30	726	1072	100	26	860	1070	66	4	342	615
Total	120	120	5322	5322	126	126	5882	5862	70	70	2853	2853

* 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.