

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2017

Fecha de Información: 21 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\$2139.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.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	509.9	191.2	101.6	388.7	21.6	53.2	68.0
15-35	744.3	879.6	571.2	207.8	8.4	236.5	300.0
36-60	21.6	6.4	1.7	0.0	4.7	21.6	0.0
61-90	24.8	5.3	0.0	0.2	5.3	24.6	0.0
91-180	25.8	52.5	9.0	0.8	43.5	24.9	0.0
>180	21.9	24.1	20.0	4.0	3.8	17.7	0.3
Total	1348.4	1159.0	703.5	601.5	87.2	378.6	368.3

* 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	6.0 %	6.0 %	5.9 %	5.9 %
15-35	5.8 %	5.9 %	5.6 %	5.8 %
36-60	-	6.0 %	5.2 %	5.3 %
61-90	-	5.4 %	4.7 %	4.8 %
91-180	-	5.1 %	4.5 %	4.9 %
>180	4.0 %	4.0 %	3.8 %	3.9 %
Total	5.8 %	5.8 %	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	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**	28	94	3392	3474	28	101	3439	3797	4	67	1577	1791
Intragrupo y off-shore***	0	0	1550	1367	0	0	1783	1160	0	0	1011	531
Otros	94	28	969	1069	101	28	866	1111	67	4	358	624
Total	122	122	5911	5911	129	129	6088	6068	71	71	2945	2945

* 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.