

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2017

Fecha de Información: 22 de junio de jueves 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\$2527.3 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	301.2	164.3	162.0	61.9	39.1	75.0
15-35	869.7	869.8	535.5	360.8	158.8	333.5	175.5
36-60	7.8	4.0	1.4	0.0	2.6	7.8	0.0
61-90	3.3	25.1	0.0	0.0	25.1	3.3	0.0
91-180	108.6	307.2	165.0	1.0	40.2	5.6	102.0
>180	25.6	81.4	62.0	22.3	19.4	3.4	0.0
Total	1291.2	1588.6	928.2	546.0	307.9	392.6	352.5

* 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	5.8 %	7.0 %	5.4 %	6.2 %
15-35	5.6 %	5.8 %	5.7 %	5.7 %
36-60	-	5.8 %	5.0 %	5.2 %
61-90	-	5.1 %	4.4 %	5.0 %
91-180	4.8 %	4.7 %	4.2 %	4.7 %
>180	-	4.6 %	4.5 %	4.5 %
Total	5.4 %	5.8 %	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	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**	27	97	3496	3518	33	102	3563	3992	4	67	1639	1866
Intragruppo y off-shore***	0	0	1592	1468	0	0	1900	1200	0	0	1025	569
Otros	97	27	971	1072	102	33	886	1137	67	4	403	633
Total	124	124	6058	6058	135	135	6349	6329	71	71	3067	3067

* 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.