

Fecha de Publicación: 29 de junio de 2017

Fecha de Información: 27 de junio de 2017 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\$1887.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.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	391.2	174.2	48.5	281.5	44.7	28.7	81.0
15-35	690.4	780.1	412.0	215.3	203.6	310.6	164.5
36-60	6.4	2.3	0.0	0.0	2.3	6.4	0.0
61-90	11.7	6.7	0.0	0.0	6.7	11.7	0.0
91-180	27.7	25.3	4.8	0.0	20.5	27.7	0.0
>180	11.5	5.5	0.0	5.0	5.5	6.5	0.0
Total	1138.9	994.0	465.3	501.8	283.3	391.6	245.5

* 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	5.6 %	5.6 %	5.8 %	5.7 %
15-35	5.3 %	5.5 %	5.3 %	5.4 %
36-60	-	6.7 %	4.9 %	5.4 %
61-90	-	5.2 %	4.7 %	4.9 %
91-180	-	4.9 %	4.6 %	4.7 %
>180	-	4.7 %	3.9 %	4.2 %
Total	5.4 %	5.5 %	5.4 %	5.5 %

* 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	26 al 30 de junio				3 al 7 de julio				10 al 14 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	106	3955	4217	11	67	1744	1989	16	83	2401	2766
Intragruppo y off-shore***	0	0	2016	1469	0	0	1060	605	0	0	1439	504
Otros	106	40	906	1171	67	11	451	660	83	16	686	1245
Total	146	146	6877	6857	78	78	3254	3254	99	99	4525	4515

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.