

Fecha de Publicación: 30 de junio de 2017

Fecha de Información: 28 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\$2424.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.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	515.9	224.9	85.0	359.7	53.9	70.2	86.0
15-35	838.3	928.3	582.5	359.6	74.9	207.7	271.0
36-60	2.2	2.6	0.0	0.0	2.6	2.2	0.0
61-90	5.6	3.5	0.0	0.0	3.5	5.6	0.0
91-180	23.1	152.6	100.0	0.0	37.6	8.1	15.0
>180	28.0	76.6	60.0	18.0	11.6	5.0	5.0
Total	1413.1	1388.5	827.5	737.3	184.1	298.8	377.0

* 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	5.8 %	14.8 %	5.7 %	8.4 %
15-35	5.5 %	5.5 %	5.5 %	5.5 %
36-60	-	6.0 %	5.1 %	5.6 %
61-90	-	5.4 %	4.6 %	4.9 %
91-180	4.5 %	4.7 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.4 %	4.4 %	4.5 %	4.4 %
Total	5.5 %	6.8 %	5.5 %	6.1 %

* 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**	42	109	4271	4305	18	67	1911	2087	20	84	2438	2840
Intragrupo y off-shore***	0	0	2060	1739	0	0	1101	695	0	0	1459	504
Otros	109	42	909	1176	67	18	466	696	84	20	724	1267
Total	150	150	7240	7220	85	85	3478	3478	104	104	4621	4611

* 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.