

Fecha de Publicación: 4 de julio de 2017

Fecha de Información: 29 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\$2679.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.2%.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	476.2	195.2	80.5	352.3	21.7	30.9	93.0
15-35	1029.1	1079.6	655.0	432.1	111.1	283.5	313.5
36-60	16.3	27.6	26.0	12.5	1.6	3.8	0.0
61-90	25.3	122.6	90.0	14.0	32.6	11.3	0.0
91-180	30.4	47.7	0.0	0.0	22.7	5.4	25.0
>180	20.4	55.4	40.0	0.0	0.4	5.4	15.0
Total	1597.7	1528.1	891.5	810.8	190.1	340.4	446.5

* 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	5.2 %	5.3 %	5.3 %	5.2 %
15-35	5.1 %	5.3 %	5.1 %	5.2 %
36-60	-	5.2 %	5.0 %	5.1 %
61-90	-	4.9 %	4.7 %	4.9 %
91-180	4.6 %	5.4 %	3.9 %	4.9 %
>180	4.4 %	4.5 %	3.8 %	4.4 %
Total	5.1 %	5.2 %	5.1 %	5.2 %

*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**	41	110	4460	4354	22	67	2082	2180	21	84	2566	2908
Intragruppo y off-shore***	0	0	2090	1911	0	0	1121	796	0	0	1489	589
Otros	110	41	908	1174	67	22	476	703	84	21	744	1292
Total	150	150	7458	7438	88	88	3679	3679	104	104	4799	4789

* 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.