

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2017

Fecha de Información: 11 de julio 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\$1684.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	455.4	235.7	46.0	250.0	29.7	45.4	160.0
15-35	496.2	696.0	334.7	131.5	176.8	180.2	184.5
36-60	32.9	34.5	0.0	0.0	4.5	2.9	30.0
61-90	11.6	6.1	0.0	10.0	6.1	1.6	0.0
91-180	33.2	26.0	0.0	15.0	16.0	8.2	10.0
>180	37.6	38.4	0.0	0.0	3.4	2.6	35.0
Total	1066.8	1036.7	380.7	406.5	236.5	240.8	419.5

* 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	4.8 %	5.0 %	5.8 %	5.3 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
36-60	4.8 %	8.0 %	4.5 %	5.2 %
61-90	-	4.7 %	4.6 %	4.6 %
91-180	4.5 %	4.5 %	4.4 %	4.5 %
>180	4.3 %	4.5 %	4.0 %	4.3 %
Total	4.7 %	4.9 %	5.2 %	5.0 %

*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	10 al 14 de julio				17 al 21 de julio				24 al 28 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	88	3290	3318	72	98	2922	3878	20	90	4106	3628
Intragruppo y off-shore***	0	0	1692	1034	0	0	2346	779	0	0	1669	1621
Otros	88	45	803	1424	98	72	465	1075	90	20	899	1425
Total	133	133	5785	5775	171	171	5733	5733	110	110	6674	6674

* 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.