

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2017

Fecha de Información: 12 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\$1899.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	429.8	205.9	27.0	274.4	39.8	16.4	139.0
15-35	676.4	766.1	403.6	202.8	131.5	242.6	231.0
36-60	30.3	37.6	0.0	0.0	37.6	30.3	0.0
61-90	13.8	11.8	4.4	0.0	7.5	13.8	0.0
91-180	10.4	63.0	0.0	0.0	53.0	0.4	10.0
>180	20.4	33.9	1.0	0.0	12.9	0.4	20.0
Total	1181.0	1118.2	436.0	477.1	282.2	303.9	400.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.9 %	7.5 %	4.8 %	5.1 %
15-35	4.9 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
36-60	-	4.9 %	4.7 %	4.8 %
61-90	-	5.2 %	4.1 %	4.6 %
91-180	4.5 %	4.7 %	4.2 %	4.7 %
>180	4.1 %	4.7 %	4.1 %	4.4 %
Total	4.8 %	5.1 %	4.7 %	4.9 %

*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

Sector	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**	46	93	3426	3357	74	102	3121	3922	20	99	4212	3817
Intragruppo y off-shore***	0	0	1692	1138	0	0	2361	942	0	0	1747	1629
Otros	93	46	807	1421	102	74	465	1083	99	20	922	1435
Total	139	139	5926	5916	176	176	5948	5948	119	119	6881	6881

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