

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2017

Fecha de Información: 14 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\$1903.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	486.4	338.7	224.3	379.7	47.4	39.7	67.0
15-35	405.9	633.6	406.0	146.0	23.6	55.9	204.0
36-60	5.9	19.1	0.0	0.0	19.1	5.9	0.0
61-90	49.4	53.7	10.7	0.0	13.0	19.4	30.0
91-180	104.0	29.2	3.0	75.6	21.2	23.4	5.0
>180	68.7	66.0	10.0	10.0	5.0	7.7	51.0
Total	1120.2	1140.3	654.0	611.3	129.3	152.0	357.0

* 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 %	1.4 %	-9.2 %	-3.9 %
15-35	4.9 %	2.0 %	3.7 %	3.1 %
36-60	-	4.9 %	4.4 %	4.8 %
61-90	4.8 %	4.9 %	4.5 %	4.7 %
91-180	4.6 %	5.0 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.3 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %
Total	4.9 %	2.1 %	-3.0 %	0.6 %

*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	3507	3380	77	111	3605	4331	21	102	4568	4060
Intragrupa y off-shore***	0	0	1712	1222	0	0	2588	1256	0	0	1897	1923
Otros	93	46	810	1418	111	77	501	1107	102	21	987	1470
Total	139	139	6030	6020	188	188	6694	6694	122	122	7453	7453

* 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 intragrupo.