

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2017

Fecha de Información: 17 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\$1638.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	473.2	280.5	206.0	396.9	8.5	10.4	66.0
15-35	383.0	601.1	380.4	65.5	73.7	170.5	147.0
36-60	44.4	5.9	0.0	0.9	5.9	43.5	0.0
61-90	6.1	12.5	0.0	2.9	12.5	3.2	0.0
91-180	14.6	8.5	0.0	13.1	8.5	1.5	0.0
>180	17.1	4.0	0.0	0.0	4.0	17.1	0.0
Total	938.5	912.5	586.4	479.3	113.1	246.2	213.0

* 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	5.0 %	5.0 %	6.1 %	5.8 %
15-35	5.0 %	5.0 %	4.7 %	4.9 %
36-60	-	4.9 %	4.3 %	4.4 %
61-90	-	4.8 %	4.5 %	4.7 %
91-180	-	5.1 %	4.6 %	4.8 %
>180	-	4.6 %	4.2 %	4.3 %
Total	5.0 %	5.0 %	5.2 %	5.1 %

*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

Sector	17 al 21 de julio				24 al 28 de julio				31 de jul. al 4 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	114	3812	4340	24	103	4832	4325	11	103	2923	3373
Intragruppo y off-shore***	0	0	2588	1451	0	0	2103	2125	0	0	1907	885
Otros	114	76	499	1109	103	24	991	1476	103	11	497	1069
Total	190	190	6899	6899	127	127	7927	7927	115	115	5327	5327

* 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.