

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2017

Fecha de Información: 21 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\$1245.6 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	276.6	219.7	95.5	139.0	18.2	31.6	106.0
15-35	325.4	558.4	343.7	56.5	59.3	113.4	155.5
36-60	1.5	6.0	0.0	0.0	6.0	1.5	0.0
61-90	7.1	5.5	0.0	0.0	5.5	7.1	0.0
91-180	65.6	17.3	0.0	60.0	12.3	0.6	5.0
>180	25.7	28.3	0.1	0.0	3.2	0.7	25.0
Total	701.9	835.1	439.2	255.5	104.4	154.9	291.5

* 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	5.6 %	6.4 %	4.9 %	5.5 %
15-35	4.9 %	4.9 %	4.7 %	4.9 %
36-60	-	5.2 %	3.9 %	4.9 %
61-90	-	5.1 %	4.1 %	4.6 %
91-180	4.6 %	5.0 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.4 %	4.5 %	3.8 %	4.4 %
Total	5.1 %	5.2 %	4.8 %	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**	26	110	4366	4425	30	108	5331	4973	13	109	3240	3484
Intragruppo y off-shore***	0	0	2623	1908	0	0	2538	2430	0	0	1959	1172
Otros	110	26	504	1160	108	30	1075	1542	109	13	550	1093
Total	136	136	7493	7493	138	138	8944	8944	122	122	5749	5749

* 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.