

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2017

Fecha de Información: 24 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\$1129.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	187.8	127.5	78.0	127.1	5.5	16.7	44.0
15-35	295.2	505.6	327.4	49.0	65.2	133.2	113.0
36-60	51.5	5.5	0.0	16.0	5.5	35.5	0.0
61-90	0.8	13.1	0.0	0.0	13.1	0.8	0.0
91-180	48.9	24.1	0.0	30.0	14.1	8.9	10.0
>180	35.1	21.8	0.0	0.0	1.8	15.1	20.0
Total	619.3	697.6	405.4	222.1	105.2	210.2	187.0

* 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	5.0 %	5.4 %	5.4 %	5.3 %
15-35	5.1 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %
36-60	-	5.4 %	4.8 %	4.9 %
61-90	-	4.9 %	4.5 %	4.9 %
91-180	4.6 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.2 %	4.9 %	4.2 %	4.2 %
Total	4.9 %	5.1 %	5.0 %	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	24 al 28 de julio				31 de jul. al 4 de agosto				7 al 11 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	108	5040	5072	14	108	3712	3513	70	63	2874	3496
Intragrupa y off-shore***	0	0	2608	2106	0	0	1967	1623	0	0	1938	845
Otros	108	33	1080	1550	108	14	551	1094	63	70	467	938
Total	141	141	8729	8729	122	122	6230	6230	133	133	5279	5279

* 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.