

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2017

Fecha de Información: 25 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\$1572.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.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	99.3	75.7	37.8	60.5	20.0	20.8	18.0
15-35	622.1	589.2	289.5	204.8	211.7	329.4	88.0
36-60	4.7	5.2	3.0	0.0	2.2	4.7	0.0
61-90	69.1	21.9	0.0	50.0	21.9	19.1	0.0
91-180	100.9	62.5	0.3	45.0	17.2	10.9	45.0
>180	29.5	63.0	40.3	0.0	2.8	9.5	20.0
Total	925.6	817.6	370.8	360.3	275.8	394.4	171.0

* 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	5.7 %	5.2 %	5.3 %	5.3 %
15-35	5.0 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %
36-60	-	5.1 %	4.0 %	4.6 %
61-90	-	4.8 %	4.6 %	4.7 %
91-180	4.6 %	4.7 %	4.2 %	4.4 %
>180	4.3 %	4.3 %	4.2 %	4.2 %
Total	4.9 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

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**	36	111	5117	5087	14	108	3731	3533	67	63	2908	3572
Intragruppo y off-shore***	0	0	2610	2167	0	0	1968	1623	0	0	1973	845
Otros	111	36	1075	1549	108	14	569	1113	63	67	502	965
Total	148	148	8803	8803	122	122	6269	6269	130	130	5383	5383

* 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.