Fecha de Publicación: 5 de julio de 2017

Fecha de Información: 30 de junio 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$1518.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	104.5	201.0	112.0	33.0	38.6	21.0	50.4
15-35	637.8	511.5	303.0	264.1	71.5	236.8	137.0
36-60	3.1	6.5	0.0	0.0	6.5	3.1	0.0
61-90	13.2	20.3	0.0	0.0	15.3	8.2	5.0
91-180	2.0	15.3	0.0	0.0	15.3	2.0	0.0
>180	39.7	165.6	148.0	0.0	7.6	29.7	10.0
Total	**800.3**	**920.3**	**563.0**	**297.1**	**154.8**	**300.8**	**202.4**

* 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	5.3 %	5.5 %	4.6 %	5.2 %
15-35	5.2 %	5.3 %	5.2 %	5.3 %
36-60	-	5.2 %	4.4 %	4.9 %
61-90	4.9 %	4.9 %	4.2 %	4.7 %
91-180	-	4.9 %	4.0 %	4.8 %
>180	4.4 %	4.4 %	4.2 %	4.4 %
Total	5.2 %	5.1 %	5.1 %	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

Sectores	26 al 30 de junio				3 al 7 de julio				10 al 14 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	109	4460	4358	22	68	2155	2352	21	84	2597	2932
Intragrupo y off-shore***	0	0	2090	1911	0	0	1215	812	0	0	1507	606
Otros	109	41	912	1174	68	22	505	711	84	21	749	1305
Total	**150**	**150**	**7462**	**7442**	**90**	**90**	**3875**	**3875**	**104**	**104**	**4854**	**4844**

* 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.