

Fecha de Publicación: 2 de agosto de 2017

Fecha de Información: 31 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\$1641.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	242.1	147.6	21.5	138.5	44.6	22.1	81.5
15-35	533.9	642.9	327.0	73.0	41.0	185.9	275.0
36-60	56.2	69.6	0.0	0.0	69.6	56.1	0.0
61-90	1.2	20.9	0.0	0.0	20.9	1.2	0.0
91-180	100.4	42.1	0.0	80.0	22.1	0.4	20.0
>180	73.3	149.0	47.0	10.0	41.0	2.3	61.0
Total	1007.1	1072.2	395.5	301.5	239.2	268.1	437.5

* 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	5.0 %	5.1 %	5.2 %	5.2 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	4.7 %	4.4 %	4.6 %
61-90	-	4.8 %	3.5 %	4.7 %
91-180	4.4 %	4.7 %	4.3 %	4.4 %
>180	4.3 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %
Total	4.6 %	4.7 %	4.7 %	4.7 %

*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	31 de jul. al 4 de agosto				7 al 11 de agosto				14 al 18 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	117	4515	3848	68	70	3536	3807	20	131	2708	3704
Intragruppo y off-shore***	0	0	2030	2152	0	0	1997	1302	0	0	2156	671
Otros	117	24	643	1187	70	68	588	1012	131	20	529	1018
Total	140	140	7187	7187	138	138	6121	6121	151	151	5393	5393

* 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.