

Fecha de Publicación: 3 de agosto de 2017

Fecha de Información: 01 de agosto 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\$1727.8 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	337.8	230.8	125.1	245.9	40.7	26.9	65.0
15-35	682.7	605.5	265.0	252.4	42.0	131.8	298.5
36-60	1.6	28.3	0.0	0.0	28.3	1.6	0.0
61-90	2.5	24.5	0.0	0.0	24.5	2.5	0.0
91-180	30.1	51.3	0.0	20.0	41.3	0.1	10.0
>180	70.2	56.0	20.0	20.0	16.0	30.2	20.0
Total	1124.9	996.5	410.1	538.3	192.8	193.0	393.5

* 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	4.6 %	5.2 %	5.0 %	4.9 %
15-35	4.6 %	4.8 %	4.6 %	4.6 %
36-60	-	5.2 %	3.9 %	5.1 %
61-90	-	4.7 %	4.0 %	4.7 %
91-180	4.3 %	4.6 %	4.3 %	4.5 %
>180	4.1 %	4.3 %	4.2 %	4.2 %
Total	4.6 %	4.8 %	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	118	4701	3984	68	69	3636	3898	20	135	2786	3733
Intragruppo y off-shore***	0	0	2155	2313	0	0	1997	1335	0	0	2178	747
Otros	118	24	644	1202	69	68	624	1024	135	20	536	1020
Total	141	141	7500	7500	137	137	6257	6257	155	155	5500	5500

* 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.