

Fecha de Publicación: 4 de agosto de 2017

Fecha de Información: 02 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\$1275.8 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	314.3	64.7	23.9	247.4	25.8	51.9	15.0
15-35	357.3	469.2	327.8	230.5	39.2	24.5	102.3
36-60	6.9	15.7	4.0	0.0	11.7	6.9	0.0
61-90	32.3	40.2	15.0	30.0	25.2	2.3	0.0
91-180	38.1	36.6	0.0	30.0	31.6	3.1	5.0
>180	10.3	22.4	0.0	0.0	12.4	0.3	10.0
Total	759.2	648.9	370.7	537.9	146.0	89.0	132.3

* 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	4.7 %	5.4 %	4.8 %	4.9 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.6 %	4.8 %
36-60	-	5.1 %	4.1 %	4.7 %
61-90	-	4.6 %	4.4 %	4.6 %
91-180	4.4 %	4.6 %	4.3 %	4.5 %
>180	4.3 %	4.5 %	4.0 %	4.4 %
Total	4.7 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %

* 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	121	4363	3999	70	70	4016	3912	20	137	3084	3814
Intragruppo y off-shore***	0	0	2172	1974	0	0	2004	1670	0	0	2208	1005
Otros	121	24	643	1203	70	70	627	1064	137	20	557	1029
Total	144	144	7177	7177	140	140	6646	6646	157	157	5849	5849

* 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.