

Fecha de Publicación: 8 de agosto de 2017

Fecha de Información: 03 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\$1799.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	320.7	272.7	94.9	153.8	44.9	33.9	133.0
15-35	623.2	679.4	376.3	84.5	98.7	334.2	204.4
36-60	58.9	32.4	0.0	52.8	32.4	6.2	0.0
61-90	0.8	37.0	7.5	0.0	29.5	0.8	0.0
91-180	30.8	51.5	0.0	20.0	41.5	0.8	10.0
>180	27.6	22.4	2.5	10.0	9.9	7.6	10.0
Total	1062.0	1095.4	481.1	321.1	256.8	383.5	357.4

* 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	4.3 %	4.9 %	4.8 %	4.6 %
15-35	4.6 %	4.6 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	4.8 %	3.7 %	4.6 %
61-90	-	4.6 %	3.9 %	4.6 %
91-180	4.4 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %
>180	4.2 %	4.6 %	4.2 %	4.3 %
Total	4.5 %	4.7 %	4.5 %	4.6 %

*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**	25	121	4522	4092	71	70	4121	4048	20	138	3138	3857
Intragrupa y off-shore***	0	0	2225	2090	0	0	2044	1697	0	0	2210	1015
Otros	121	25	639	1203	70	71	653	1071	138	20	578	1054
Total	145	145	7385	7385	141	141	6817	6817	158	158	5926	5926

* 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.