

Fecha de Publicación: 9 de agosto de 2017

Fecha de Información: 04 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\$1421.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	377.6	343.7	182.0	230.0	63.0	48.8	98.8
15-35	269.9	558.6	399.5	69.3	31.1	72.6	128.1
36-60	37.4	6.9	0.0	30.0	6.9	7.4	0.0
61-90	3.7	10.9	0.0	0.0	10.9	3.7	0.0
91-180	12.1	31.3	5.0	0.0	14.3	0.1	12.0
>180	3.1	4.6	0.0	0.0	4.6	3.1	0.0
Total	703.8	956.1	586.5	329.3	130.8	135.8	238.8

* 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 %	4.8 %	4.6 %	4.6 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.4 %	4.6 %
36-60	4.8 %	5.3 %	4.4 %	4.5 %
61-90	-	5.1 %	3.1 %	4.6 %
91-180	4.4 %	4.7 %	4.2 %	4.6 %
>180	-	4.5 %	3.5 %	4.1 %
Total	4.6 %	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

Sectores	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	119	4522	4094	50	74	4361	4258	21	140	3274	3982
Intragruppo y off-shore***	0	0	2225	2090	0	0	2175	1886	0	0	2261	1057
Otros	119	25	641	1203	74	50	690	1081	140	21	595	1091
Total	144	144	7388	7388	124	124	7226	7226	161	161	6130	6130

* 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 intragruppo.