

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1947.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	249.9	225.0	92.5	110.5	64.5	71.4	68.0
15-35	700.9	872.4	381.8	74.0	254.6	390.9	236.0
36-60	135.8	135.2	0.0	4.1	5.2	1.7	130.0
61-90	11.0	11.5	0.0	0.0	1.5	1.0	10.0
91-180	10.3	22.1	0.0	0.0	22.1	10.3	0.0
>180	12.9	14.1	0.0	0.0	4.1	2.9	10.0
Total	1120.9	1280.4	474.3	188.6	352.1	478.3	454.0

* 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	4.9 %	4.9 %	4.7 %	4.9 %
15-35	4.9 %	5.0 %	5.6 %	5.2 %
36-60	4.8 %	6.0 %	3.8 %	4.9 %
61-90	4.7 %	4.9 %	3.8 %	4.7 %
91-180	-	4.7 %	4.3 %	4.6 %
>180	4.2 %	4.6 %	4.0 %	4.2 %
Total	4.9 %	5.0 %	5.4 %	5.1 %

*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	7 al 11 de agosto				14 al 18 de agosto				21 al 25 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	89	4283	4410	23	144	3486	4532	52	104	3113	2552
Intragruppo y off-shore***	0	0	2288	1743	0	0	2643	1086	0	0	1397	1600
Otros	89	25	680	1097	144	23	649	1160	104	52	465	824
Total	114	114	7251	7251	167	167	6778	6778	156	156	4975	4975

* 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.