

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2017

Fecha de Información: 11 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\$1331.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	338.9	192.5	94.5	187.0	35.0	88.9	63.0
15-35	367.9	410.7	252.8	153.5	77.0	133.4	81.0
36-60	36.5	42.2	0.0	0.0	7.2	1.5	35.0
61-90	1.6	27.1	0.0	0.0	27.1	1.6	0.0
91-180	45.8	49.8	0.0	20.0	29.8	5.8	20.0
>180	11.3	15.9	0.0	0.0	5.9	1.3	10.0
Total	801.9	738.3	347.3	360.5	182.0	232.4	209.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.2 %	4.9 %	5.0 %	5.0 %
15-35	4.9 %	5.0 %	4.8 %	4.9 %
36-60	4.8 %	5.1 %	4.6 %	4.9 %
61-90	-	4.8 %	4.6 %	4.8 %
91-180	4.6 %	4.6 %	4.6 %	4.6 %
>180	4.3 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %
Total	4.9 %	5.0 %	4.9 %	4.9 %

*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	24	146	3703	4585	52	106	3232	2686
Intragruppo y off-shore***	0	0	2288	1743	0	0	2657	1248	0	0	1477	1625
Otros	89	25	680	1097	146	24	660	1187	106	52	484	883
Total	113	113	7251	7251	170	170	7020	7020	158	158	5193	5193

* 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.