

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2017

Fecha de Información: 14 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\$1517.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	395.9	397.6	45.8	59.1	290.8	275.8	61.0
15-35	328.1	370.7	178.3	66.5	51.4	120.6	141.0
36-60	28.7	19.8	0.0	0.0	19.8	28.7	0.0
61-90	2.2	12.0	0.0	0.0	12.0	2.2	0.0
91-180	65.6	28.5	0.0	60.0	28.5	5.6	0.0
>180	22.5	47.5	30.0	20.0	17.5	2.5	0.0
Total	843.0	876.0	254.1	205.6	420.0	435.4	202.0

* 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	5.1 %	5.0 %	4.8 %	4.9 %
15-35	5.1 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %
36-60	-	5.0 %	4.4 %	4.6 %
61-90	-	5.0 %	4.5 %	4.9 %
91-180	-	4.8 %	4.5 %	4.6 %
>180	-	4.3 %	4.0 %	4.3 %
Total	5.1 %	5.0 %	4.8 %	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	14 al 18 de agosto				21 al 25 de agosto				28 de ago. al 1 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	148	4029	4901	52	110	3267	2723	133	114	3813	4304
Intragrupa y off-shore***	0	0	2692	1292	0	0	1488	1640	0	0	1897	1097
Otros	148	24	927	1454	110	52	497	890	114	133	1119	1417
Total	173	173	7648	7648	162	162	5253	5253	247	247	6829	6819

* 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 intragrupo.