

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2017

Fecha de Información: 15 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\$1817.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	287.3	194.2	76.0	166.4	14.2	16.9	104.0
15-35	680.8	840.6	397.7	191.0	164.9	211.8	278.0
36-60	4.9	5.3	0.0	0.0	5.3	4.9	0.0
61-90	1.0	4.7	0.0	0.0	4.7	1.0	0.0
91-180	20.1	24.8	0.4	20.0	24.4	0.1	0.0
>180	98.7	97.1	31.0	0.0	6.1	38.7	60.0
Total	1092.8	1166.6	505.1	377.4	219.5	273.5	442.0

* 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	4.7 %	5.1 %	4.9 %	4.9 %
15-35	5.1 %	5.2 %	4.9 %	5.1 %
36-60	-	5.2 %	4.7 %	5.0 %
61-90	-	5.1 %	4.4 %	5.0 %
91-180	-	4.7 %	4.6 %	4.7 %
>180	4.3 %	4.2 %	4.0 %	4.2 %
Total	4.9 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %

* 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	149	4241	5055	33	112	3322	2734	153	114	3873	4407
Intragrupa y off-shore***	0	0	2763	1424	0	0	1488	1674	0	0	1935	1097
Otros	149	24	932	1456	112	33	502	904	114	153	1123	1417
Total	173	173	7936	7936	145	145	5312	5312	267	267	6931	6922

* 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.