

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2017

Fecha de Información: 16 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\$1625.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.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	352.2	138.9	22.8	301.0	76.1	11.2	40.0
15-35	437.4	693.1	451.5	127.8	42.6	110.7	199.0
36-60	21.2	53.3	20.0	0.0	13.3	1.2	20.0
61-90	5.7	21.2	0.0	0.0	21.2	5.7	0.0
91-180	55.2	107.2	43.1	10.0	28.2	9.2	36.0
>180	7.1	27.9	0.0	0.0	27.9	7.1	0.0
Total	878.7	1041.7	537.3	438.8	209.4	145.0	295.0

* 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	4.7 %	5.6 %	4.8 %	5.0 %
15-35	5.0 %	5.1 %	5.2 %	5.1 %
36-60	4.9 %	5.2 %	4.6 %	5.1 %
61-90	-	5.1 %	4.1 %	4.9 %
91-180	4.6 %	4.8 %	4.5 %	4.7 %
>180	-	5.0 %	4.9 %	5.0 %
Total	4.9 %	5.2 %	5.0 %	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	150	4526	5098	28	114	3368	2805	158	115	3937	4491
Intragruppo y off-shore***	0	0	2770	1670	0	0	1488	1719	0	0	1974	1107
Otros	150	24	933	1460	114	28	573	905	115	158	1123	1426
Total	174	174	8228	8228	142	142	5429	5429	273	273	7034	7024

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.