

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2017

Fecha de Información: 17 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\$2009.7 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	451.4	337.4	46.5	177.9	208.9	191.6	82.0
15-35	596.1	669.6	475.0	130.5	89.6	360.6	105.0
36-60	19.5	6.3	0.0	0.0	5.3	18.5	1.0
61-90	1.3	12.9	0.0	0.0	12.9	1.3	0.0
91-180	2.7	6.3	0.0	0.0	6.3	2.7	0.0
>180	48.8	57.0	40.0	31.5	5.5	5.8	11.5
Total	1119.7	1089.5	561.5	339.9	328.5	580.4	199.5

* 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	5.0 %	5.0 %	4.7 %	4.9 %
15-35	5.0 %	5.0 %	4.9 %	4.9 %
36-60	4.8 %	5.3 %	4.6 %	4.8 %
61-90	-	5.2 %	4.3 %	5.2 %
91-180	-	4.9 %	4.3 %	4.7 %
>180	4.1 %	4.2 %	4.2 %	4.2 %
Total	4.9 %	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	4645	5098	26	117	2614	2998	162	115	4037	4650
Intragrupa y off-shore***	0	0	2770	1782	0	0	1511	786	0	0	2013	1107
Otros	148	24	933	1467	117	26	731	1072	115	162	1174	1456
Total	173	173	8347	8347	143	143	4856	4856	277	277	7224	7214

* 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.