

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2017

Fecha de Información: 18 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\$1251.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	249.0	217.7	94.5	118.0	22.2	30.0	101.0
15-35	427.4	444.8	246.8	115.5	31.0	144.9	167.0
36-60	12.7	6.8	0.0	0.0	6.8	12.7	0.0
61-90	27.1	14.0	0.0	0.0	14.0	27.1	0.0
91-180	66.8	11.3	0.0	65.0	11.3	1.8	0.0
>180	30.4	17.4	0.0	10.5	11.4	13.9	6.0
Total	813.5	712.0	341.3	309.0	96.7	230.5	274.0

* 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	5.0 %	5.3 %	3.1 %	4.3 %
15-35	4.9 %	5.0 %	4.7 %	4.8 %
36-60	-	6.4 %	4.6 %	5.2 %
61-90	-	5.2 %	4.6 %	4.8 %
91-180	-	5.2 %	4.5 %	4.6 %
>180	4.0 %	4.5 %	4.1 %	4.2 %
Total	4.9 %	5.1 %	4.2 %	4.7 %

*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

Sectores	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	146	4645	5099	29	117	2728	3089	163	115	4168	4775
Intragrupa y off-shore***	0	0	2770	1782	0	0	1566	866	0	0	2052	1146
Otros	146	24	933	1467	117	29	741	1081	115	163	1184	1473
Total	171	171	8348	8348	145	145	5035	5035	277	277	7404	7394

* 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.