

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2017

Fecha de Información: 22 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\$1075.6 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	157.4	122.0	22.0	77.0	60.0	40.4	40.0
15-35	392.1	442.1	255.0	50.4	111.1	265.7	76.0
36-60	3.4	11.9	0.0	0.0	11.9	3.4	0.0
61-90	5.0	15.8	0.0	0.0	15.8	5.0	0.0
91-180	1.6	17.1	0.0	0.0	17.1	1.6	0.0
>180	18.9	4.4	0.0	14.5	4.4	4.4	0.0
Total	578.4	613.3	277.0	141.9	220.3	320.5	116.0

* 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	4.9 %	5.4 %	4.9 %	5.1 %
15-35	4.9 %	5.0 %	4.7 %	4.9 %
36-60	-	5.5 %	4.6 %	5.3 %
61-90	-	5.0 %	4.5 %	4.9 %
91-180	-	4.8 %	4.4 %	4.8 %
>180	-	4.5 %	4.1 %	4.1 %
Total	4.9 %	5.0 %	4.7 %	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	21 al 25 de agosto				28 de ago. al 1 de septiembre				4 al 8 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	123	2782	3109	163	116	4270	4863	12	81	3928	3332
Intragrupa y off-shore***	0	0	1588	913	0	0	2052	1176	0	0	1727	1578
Otros	123	28	733	1081	116	163	1238	1512	81	12	577	1322
Total	150	150	5104	5104	279	279	7560	7551	92	92	6232	6232

* 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.