

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2017

Fecha de Información: 23 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\$1935.8 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	657.9	402.9	72.0	329.0	180.9	178.9	150.0
15-35	312.6	578.8	433.5	143.8	18.3	41.9	127.0
36-60	77.7	77.6	0.0	0.0	76.6	76.7	1.0
61-90	24.1	18.5	0.0	20.0	18.5	4.1	0.0
91-180	4.8	32.3	20.0	0.0	12.3	4.8	0.0
>180	11.9	20.3	0.0	5.5	14.8	0.9	5.5
Total	1088.9	1130.4	525.5	498.3	321.4	307.2	283.5

* 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 %	4.9 %	4.9 %
15-35	5.0 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %
36-60	4.7 %	4.8 %	4.7 %	4.8 %
61-90	-	4.8 %	4.9 %	4.9 %
91-180	-	4.6 %	4.4 %	4.6 %
>180	4.1 %	4.4 %	4.1 %	4.3 %
Total	5.0 %	4.9 %	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	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	118	3039	3230	163	135	4662	5125	12	81	3965	3348
Intragrupa y off-shore***	0	0	1634	1090	0	0	2078	1328	0	0	1733	1598
Otros	118	28	734	1088	135	163	1399	1677	81	12	577	1329
Total	146	146	5408	5408	298	298	8140	8130	92	92	6275	6275

* 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.