

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2017

Fecha de Información: 28 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\$1830.2 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	350.2	319.2	52.0	73.0	188.2	198.2	79.0
15-35	501.8	589.6	268.8	75.3	190.3	295.9	130.6
36-60	1.3	8.4	0.0	0.0	8.4	1.3	0.0
61-90	4.6	8.1	0.0	0.0	8.1	4.6	0.0
91-180	189.3	34.5	0.0	185.0	34.5	4.3	0.0
>180	20.0	12.7	0.0	0.0	12.7	20.0	0.0
Total	1067.2	972.5	320.8	333.3	442.2	524.3	209.6

* 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	5.1 %	5.3 %	5.1 %	5.2 %
15-35	5.1 %	5.1 %	4.8 %	5.0 %
36-60	-	5.4 %	4.8 %	5.3 %
61-90	-	5.2 %	4.7 %	5.0 %
91-180	-	4.7 %	4.7 %	4.7 %
>180	-	4.5 %	4.0 %	4.2 %
Total	5.1 %	5.1 %	4.9 %	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

Sectores	28 de ago. al 1 de septiembre				4 al 8 de septiembre				11 al 15 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	165	143	5207	5678	12	87	4129	3575	20	134	2606	3132
Intragruppo y off-shore***	0	0	2174	1383	0	0	1854	1632	0	0	1739	693
Otros	143	165	1651	1962	87	12	612	1388	134	20	621	1141
Total	309	309	9033	9023	99	99	6595	6595	155	155	4965	4965

* 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.