

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2017

Fecha de Información: 29 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\$1698.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	368.2	326.6	83.8	115.9	193.3	202.8	49.6
15-35	554.5	466.6	184.4	220.0	202.7	255.0	79.5
36-60	7.7	8.8	0.0	0.0	3.8	2.7	5.0
61-90	4.3	29.5	0.0	0.0	29.5	4.3	0.0
91-180	29.4	17.7	0.0	20.0	8.6	0.3	9.1
>180	26.7	7.9	0.0	20.0	1.9	0.7	6.0
Total	990.9	857.0	268.2	375.9	439.7	465.8	149.2

* 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	5.4 %	5.2 %	5.1 %	5.2 %
15-35	5.3 %	5.2 %	5.0 %	5.1 %
36-60	4.7 %	5.6 %	4.8 %	5.0 %
61-90	-	5.1 %	4.5 %	5.0 %
91-180	4.4 %	5.0 %	4.6 %	4.7 %
>180	4.1 %	4.7 %	4.3 %	4.3 %
Total	5.2 %	5.2 %	5.0 %	5.1 %

*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**	164	142	5478	5960	13	89	4153	3584	25	135	2739	3206
Intragruppo y off-shore***	0	0	2258	1441	0	0	1854	1649	0	0	1739	756
Otros	142	164	1833	2159	89	13	617	1391	135	25	641	1157
Total	306	306	9569	9560	102	102	6624	6624	160	160	5119	5119

* 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.