

Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 30 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\$2399.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.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	711.7	317.2	78.0	444.8	143.2	170.9	96.0
15-35	659.7	944.1	455.3	226.1	242.3	187.1	246.5
36-60	3.9	5.5	0.0	1.0	5.5	3.0	0.0
61-90	3.3	20.8	0.0	0.0	20.8	3.3	0.0
91-180	0.3	20.2	0.0	0.0	20.2	0.3	0.0
>180	25.1	53.5	20.0	0.0	10.5	2.1	23.0
Total	1404.0	1361.3	553.3	671.8	442.5	366.7	365.5

* 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	3.3 %	5.1 %	5.2 %	4.9 %
15-35	5.2 %	5.3 %	4.9 %	5.2 %
36-60	-	5.4 %	4.4 %	5.0 %
61-90	-	5.2 %	4.4 %	5.1 %
91-180	-	4.9 %	4.4 %	4.9 %
>180	4.4 %	4.4 %	4.0 %	4.3 %
Total	4.6 %	5.2 %	5.1 %	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	143	5852	6010	13	90	4454	3814	25	140	2809	3325
Intragrupa y off-shore***	0	0	2275	1777	0	0	1911	1751	0	0	1792	763
Otros	143	164	1835	2166	90	13	735	1534	140	25	674	1187
Total	307	307	9962	9952	103	103	7099	7099	165	165	5274	5274

* 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.