

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 31 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\$1983.9 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	595.2	408.9	51.0	263.4	237.2	211.1	120.8
15-35	622.7	448.9	226.8	224.0	62.8	239.5	159.3
36-60	4.2	8.0	0.0	0.0	8.0	4.2	0.0
61-90	28.2	41.2	0.0	0.0	33.2	20.2	8.0
91-180	1.4	34.3	0.0	0.0	34.3	1.4	0.0
>180	18.5	66.4	55.0	10.0	5.4	2.5	6.0
Total	1270.2	1007.7	332.8	497.4	380.8	478.8	294.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.8 %	5.1 %	5.1 %	5.0 %
15-35	4.9 %	5.4 %	5.0 %	5.0 %
36-60	-	5.5 %	4.6 %	5.2 %
61-90	4.7 %	5.1 %	4.5 %	4.8 %
91-180	-	4.7 %	3.8 %	4.7 %
>180	4.1 %	4.4 %	3.8 %	4.3 %
Total	4.8 %	5.0 %	5.0 %	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

Sector	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	145	6041	6018	13	89	4558	4103	26	138	3132	3440
Intragruppo y off-shore***	0	0	2282	1942	0	0	1953	1617	0	0	1796	996
Otros	145	165	1836	2190	89	13	894	1685	138	26	753	1244
Total	310	310	10159	10149	102	102	7405	7405	163	163	5680	5680

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.