

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$1582.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	431.8	399.8	67.5	66.0	221.3	254.8	111.0
15-35	505.5	514.0	225.1	118.5	50.9	149.0	238.0
36-60	7.8	3.5	0.0	0.0	3.5	7.8	0.0
61-90	1.8	19.6	0.0	0.0	19.6	1.8	0.0
91-180	1.7	18.1	0.0	0.0	18.1	1.7	0.0
>180	20.5	7.2	0.0	20.0	7.2	0.5	0.0
Total	969.1	962.2	292.6	204.5	320.6	415.6	349.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.0 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %
15-35	4.9 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %
36-60	-	5.3 %	4.3 %	4.6 %
61-90	-	5.0 %	4.5 %	5.0 %
91-180	-	5.4 %	4.5 %	5.3 %
>180	-	4.9 %	4.1 %	4.3 %
Total	4.9 %	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

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	6041	6018	17	91	4779	4268	26	138	3337	3673
Intragruppo y off-shore***	0	0	2282	1942	0	0	1990	1683	0	0	1826	996
Otros	143	165	1836	2190	91	17	936	1755	138	26	930	1423
Total	308	308	10159	10150	108	108	7705	7705	164	164	6093	6093

* 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.