

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 11 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\$1377.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	308.3	248.7	80.5	142.0	35.7	33.8	132.5
15-35	419.2	444.2	176.3	105.5	44.9	90.7	223.0
36-60	146.0	96.5	0.0	0.0	46.5	96.0	50.0
61-90	5.5	6.1	0.0	0.0	6.1	5.5	0.0
91-180	60.5	93.4	20.0	10.0	23.4	0.5	50.0
>180	0.3	4.1	0.0	0.0	4.1	0.3	0.0
Total	939.8	892.9	276.8	257.5	160.7	226.8	455.5

* 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	4.8 %	5.0 %	4.4 %	4.7 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.6 %	4.7 %
36-60	4.5 %	4.7 %	4.6 %	4.6 %
61-90	-	5.4 %	4.3 %	4.9 %
91-180	4.3 %	4.4 %	4.3 %	4.3 %
>180	-	4.6 %	4.1 %	4.6 %
Total	4.6 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %

*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	11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	143	4493	4124	11	151	3736	3684	16	142	3495	3765
Intragrupa y off-shore***	0	0	1973	1766	0	0	2023	1481	0	0	1491	1064
Otros	143	18	1031	1607	151	11	650	1244	142	16	954	1113
Total	161	161	7497	7497	162	162	6409	6409	158	158	5941	5941

* 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 intragrupo.