

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 13 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\$3095.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	558.7	226.9	101.5	424.9	21.4	29.8	104.0
15-35	974.7	1315.0	692.5	159.0	213.0	406.2	409.5
36-60	42.1	101.9	60.0	0.0	7.4	7.6	34.5
61-90	8.6	10.5	0.0	0.0	10.5	8.6	0.0
91-180	60.4	46.6	10.1	40.0	16.5	0.4	20.0
>180	172.3	215.5	130.0	100.0	15.5	2.3	70.0
Total	1816.8	1916.5	994.1	723.9	284.4	455.0	638.0

* 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	4.6 %	4.7 %	4.4 %	4.5 %
15-35	4.6 %	4.5 %	4.3 %	4.5 %
36-60	4.2 %	4.4 %	4.4 %	4.3 %
61-90	-	4.6 %	3.4 %	4.0 %
91-180	4.1 %	4.5 %	4.1 %	4.2 %
>180	3.8 %	4.0 %	3.9 %	3.9 %
Total	4.5 %	4.5 %	4.3 %	4.4 %

*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**	19	138	4556	4191	14	153	4445	4023	17	143	3640	3930
Intragruppo y off-shore***	0	0	2005	1776	0	0	2203	2032	0	0	1518	1101
Otros	138	19	1024	1619	153	14	687	1281	143	17	1002	1129
Total	157	157	7585	7585	167	167	7335	7335	159	159	6159	6159

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