

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 14 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\$1604.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	284.0	275.1	159.8	158.5	18.9	29.0	96.5
15-35	510.0	361.0	228.8	170.0	55.3	263.0	77.0
36-60	51.7	5.5	0.0	0.0	5.5	51.7	0.0
61-90	31.9	31.9	0.0	0.0	31.9	31.9	0.0
91-180	90.6	34.6	0.0	90.0	34.6	0.6	0.0
>180	42.6	78.9	45.0	15.0	13.9	7.6	20.0
Total	1010.8	787.1	433.5	433.5	160.1	383.9	193.5

* 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	5.1 %	4.8 %	4.7 %	4.8 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	4.9 %	4.2 %	4.3 %
61-90	-	4.7 %	2.1 %	3.4 %
91-180	-	4.2 %	4.1 %	4.2 %
>180	3.9 %	4.0 %	4.0 %	4.0 %
Total	4.8 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %

* 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	139	4435	4235	16	154	4791	4232	17	143	3718	3956
Intragrupo y off-shore***	0	0	2017	1640	0	0	2350	2282	0	0	1519	1145
Otros	139	19	1043	1620	154	16	676	1304	143	17	1016	1152
Total	158	158	7495	7495	169	169	7817	7817	159	159	6252	6252

* 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.